

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ, МОЛОДІ ТА СПОРТУ УКРАЇНИ

**ХАРКІВСЬКА НАЦІОНАЛЬНА АКАДЕМІЯ
МІСЬКОГО ГОСПОДАРСТВА**

В. М. Охріменко, Т. Б. Воронкова, О. О. Воронков

**КОНСПЕКТ ЛЕКЦІЙ
з курсу**

«МАТЕМАТИЧНЕ ПРОГРАМУВАННЯ»

*(для слухачів другої вищої освіти ФПО та ЗН
спеціальностей 7.050107 «Економіка підприємства»,
7.050106 «Облік і аудит»)*

**Харків
ХНАМГ
2012**

Охріменко В. М. Конспект лекцій з курсу «Математичне програмування»
(для слухачів другої вищої освіти ФПО та ЗН спеціальностей 7.050107 «Економіка підприємства», 7.050106 «Облік і аудит») / В. М. Охріменко, Т. Б. Воронкова, О. О. Воронков; Харк. нац. акад. міськ. госп-ва. – Х.: ХНАМГ, 2012.– 112 с.

Автори: доц. В. М. Охріменко,
ст.викл. Т. Б. Воронкова,
ст.викл. О. О. Воронков

Рецензент к.т.н., доц. О. Б. Костенко

Рекомендовано кафедрою інформаційних систем і технологій в міському господарстві, протокол № 79 від 31.08.11 р.

ЗМІСТ

ВСТУП.....	5
ЗМ 1. Особливості й сфери застосування математичного програмування в економіці. Класифікація задач. Лінійне програмування.....	7
Тема 1. Предмет і особливості застосування математичного програмування в економіці	7
Контрольні запитання	17
Тема 2. Лінійне програмування	18
2.1. Загальна форма задачі лінійного програмування (ЗЛП)	18
2.2. Основні властивості ЗЛП та її перша геометрична інтерпретація.....	19
2.3. Канонічна форма задачі лінійного програмування (КЗЛП).....	23
2.4. Симплекс-метод.....	26
Контрольні запитання	33
Тема 3. Транспортна задача.....	34
3.1. Транспортна задача в матричній постановці та її властивості	34
3.2. Методи побудови опорного плану	35
3.3. Метод потенціалів	38
3.4. Випадок виродження.....	42
3.5. Транспортна задача за критерієм часу	43
Контрольні запитання	45
ЗМ 2. Економічна інтерпретація й аналіз оптимальних планів лінійних економіко-математичних моделей.....	46
Тема 4. Теорія подвійності та двоїсті оцінки в аналізі розв'язків лінійних оптимізаційних моделей.....	46
4.1. Пряма та двоїста задачі як пара сполучених задач ЛП	46
4.2. Основні теореми подвійності, їх економічний зміст.....	48
4.3. Двоїсті оцінки і дефіцитність ресурсів	51
Контрольні запитання	51
Тема 5. Аналіз лінійних моделей економічних задач.....	52
5.1. Аналіз розв'язків лінійних економіко-математичних моделей.....	52
5.2. Аналіз параметричної стійкості розв'язків ЗЛП.....	56
5.3. Оцінка рентабельності виробленої продукції	58
5.4. Аналіз обмежень дефіцитних і недефіцитних ресурсів	59
Контрольні запитання	60
ЗМ 3. Вибрані розділи математичного програмування	61
Тема 6. Цілочислові та дрібно-лінійні задачі лінійного програмування.....	61
6.1. Типи задач дискретного програмування.....	61
6.2. Метод Гоморі	63
6.3. Метод віток і границь	66
6.4. Дрібно-лінійне програмування	68
Контрольні запитання	69
Тема 7. Нелінійне програмування	70
7.1. Постановка задачі нелінійного програмування (ЗНП).....	70
7.2. Класичний метод оптимізації з використанням множників Лагранжа	72

7.3. Опукле програмування	73
7.4. Необхідні й достатні умови існування сідлової точки. Теорема Куна-Таккера.....	75
7.5. Деякі методи розв'язання задач НЛП	79
Контрольні запитання	84
Тема 8. Динамічне програмування	85
8.1. Загальна схема методів динамічного програмування	85
8.2. Основні типи задач і моделі динамічного програмування	88
Контрольні запитання	93
Тема 9. Прийняття рішень в умовах невизначеності й ризику.....	94
9.1. Загальна математична постановка задачі стохастичного програму- вання (СП)	94
9.2. Класифікація задач стохастичного програмування. Основні методи розв'язання	95
9.3. Імітаційне моделювання	97
9.4. Прийняття рішень в умовах невизначеності й ризику	99
Контрольні запитання	103
Тема 10. Елементи теорії ігор	104
10.1. Основні поняття теорії ігор	104
10.2. Змішані стратегії. Основна теорема теорії ігор.....	107
10.3. Зведення гри двох гравців до задачі лінійного програмування	109
Контрольні запитання	111
Список джерел	111

ВСТУП

Математичне програмування є найважливішим розділом науки «Дослідження операцій», зміст якої є комплексом наукових методів з розв'язання задач ефективного керування діяльністю великих промислових підприємств. Такі задачі є задачами організаційно-управлінського характеру.

До промислової революції керівництво дрібним підприємством могла здійснювати усього одна людина, що робила закупівлі, планувала і спрямовувала роботу, збувала продукцію, наймала і звільняла робітників. Невеликі розміри підприємства дозволяли їй приймати організаційні рішення, не прибігаючи до будь-яких наукових методів і базуючись на своїх знаннях, досвіді й інтуїції. Якщо деякі з ухвалених рішень були не найкращими, то вони або не приводили до великого збитку, або могли бути швидко виправлені. Укрупнення промислових підприємств унеможливило здійснення адміністративних функцій однією людиною. З'явилися керівники виробничих відділів, відділів збуту, фінансових відділів, відділів кадрів та ін. Зростання автоматизації виробництва призвело до подальшого розчленовування адміністративних функцій. Так, виробничі відділи опинилися розділеними на дрібніші групи, що займаються питаннями експлуатації й ремонту, контролю якості, планування, постачання, зберігання готової продукції та ін.

Кожний окремий спеціалізований підрозділ великої організації виконує певну частину спільної роботи, керуючись спільними цілями підприємства. Однак у кожного спеціалізованого підрозділу виникають і свої власні цілі. Всі ці цілі не завжди погоджуються, а іноді заходять у суперечність одна з одною. Як приклад можна розглянути проблему забезпечення підприємства запасами. Окремий підрозділ може бути зацікавленим в значному збільшенні запасів на складі для забезпечення безперебійного випуску своєї продукції. Але при обмеженому об'ємі складських приміщень це призводить до зниження запасів для інших підрозділів. У результаті виникає задача організаційно-управлінського типу - розробка такої стратегії відносно запасів, що була б найсприятливіша для всього підприємства в цілому.

При розв'язанні подібних організаційно-управлінських задач необхідне дуже тонке розуміння цілей окремих підрозділів і таке їх узгодження, щоб вони не заходили в суперечність ні один з одним, ні із спільними цілями всього підприємства. Якщо при цьому врахувати, що прийняття не кращих рішень в умовах великого підприємства може принести чималий збиток, то стає ясно, що при розв'язанні організаційно-управлінських задач неприпустимо ґрунтуватися тільки на особистому досвіді й здоровому глузді. Необхідно застосовувати наукові методи.

Розробкою наукових методів з розв'язання організаційно-управлінських задач займається наукова дисципліна «Математичне програмування», на якій і ґрунтуються методи дослідження операцій. Під операцією в цьому випадку розуміють певний організаційний захід, проведення якого переслідує певну чітко сформульовану мету, наприклад регламентацію збережених на складі запасів. Повинні бути задані умови, що характеризують обстановку здійснення заходу,

зокрема, потреби в запасах і обмеження на складські приміщення в розглянутому прикладі. Метою досліджень є знаходження й наукове обґрунтування таких способів здійснення заходу, які в певному сенсі є найвигіднішими.

Різні види задач з керування відрізняються одна від одної способом і послідовністю виконання операцій. Однак типовим для задач керування є випадок, коли наявна інформація буває або недостатня для точної оцінки ситуації, або викривлена сторонніми факторами. Проте, недостатність інформації не знімає задачі прийняття рішення. Особливість задач керування саме в тому і перебуває, що рішення повинне бути обов'язково прийнятим незалежно від того, чи можемо ми точно оцінити результати, до яких призведе ухвалене рішення.

Отже, у процесі керування виникає важливе завдання з прийняття рішення в умовах, коли інформація про сформовану ситуацію або недостатня, або викривлена. Це завдання одержало назву завдання прийняття рішення в умовах невизначеності.

У математичному програмуванні задачу керування розглядають як математичну задачу. Однак на відміну від багатьох інших математичних задач вона має не один розв'язок, а множину різних розв'язків. Це пов'язане з тим, що в задачах керування є, як правило, багато способів організації будь-якого процесу, що призводять до досягнення поставленої цілі. Тому задачу керування можна було б ставити як задачу знаходження хоча б одного з можливих способів досягнення поставленої цілі. Однак така постановка питання зазвичай буває недостатньою.

Якщо є безліч розв'язків, виникає додаткова задача - вибрати із цієї множини розв'язків такий, що з певної точки зору є найкращим. Можна навести багато прикладів таких задач. Наприклад, з одного міста до іншого можна проїхати, різними видами транспорту: залізничним, повітряним, водним, автобусним, автомобільним. Додатковою задачею можна вважати вибір найвигіднішого виду транспорту з погляду часу проїзду, вартості, зручності та ін.

**ЗМ 1. Особливості й сфери застосування математичного
програмування в економіці. Класифікація задач.
Лінійне програмування**

**ТЕМА 1.
ПРЕДМЕТ І ОСОБЛИВОСТІ ЗАСТОСУВАННЯ МАТЕМАТИЧНОГО
ПРОГРАМУВАННЯ В ЕКОНОМІЦІ**

Предметом математичного програмування є математичні методи кількісного обґрунтування рішень у задачах, що пов'язані з *управлінням організаційними системами*.

Нагадаємо, що *системою* називають сукупність взаємопов'язаних елементів, які об'єднані *спільною ціллю* функціонування. Під *організаційною системою* розуміють певну організацію, наприклад, виробниче підприємство. Хоча в загальному випадку природа таких систем може бути різною, зокрема, це можуть бути біологічні, соціологічні або інші процеси.

Системи, що зустрічаються на практиці, в залежності від їх структури й характеру зв'язків поділяють на детерміновані й імовірнісні. *Детермінованою* називають систему, закони руху якої точно відомі й майбутню поведінку якої можна передбачити. Для *імовірнісної* системи не можна зробити точного прогнозування її майбутньої поведінки. Прикладом детермінованої системи може служити годинниковий механізм. Системи статистичного контролю продукції, системи прибуття кораблів у морські порти або запас товарів на складі, що має велику кількість постачальників і споживачів, є імовірнісними системами.

Ціллю системи називають певний (заданий ззовні або встановлюваний самою системою) найкращий кінцевий стан (наприклад, параметри вихідних характеристик), тобто деяка підмножина значень функції системи.

Структура системи зумовлюється розташуванням і взаємозв'язками між її елементами, які утворені для виконання системою своєї функції, тобто залежить від величини й складності системи. Величина системи характеризується числом її елементів і кількістю зв'язків між ними, а складність - різноманіттям елементів, неоднорідністю їх властивостей і різною якістю зв'язків.

Великим і складним системам, таким як промислове підприємство, притаманні властивості *цілісності* й *емерджентності*.

Цілісність системи означає, що всі її частини слугують спільній цілі й сприяють формуванню найкращих (оптимальних) результатів у змісті прийнятого критерію ефективності.

Емерджентність (поява нового) означає, що великі й складні системи мають такі властивості, яких немає в жодного з її елементів. Емерджентні або системні якості кардинально відрізняють системи від не систем. Інакше кажучи, об'єднання підсистем з різною природою (наприклад, економічної, технічної, соціальної) і структурою в складні системи відбувається при їх взаємовпливі одна на одну, що й створює нову системну якість, яка не властива жодній з підсистем.

Визначимо зміст терміна «*управління*». У широкому значенні слова під управлінням розуміють організаційну діяльність з що здійснює функції керівництва роботою, спрямованою на досягнення певних цілей. Процес управління полягає в прийнятті рішень про найбільш доцільні дії в тій або іншій сформованій ситуації. Людина, що здійснює управління, приймає рішення, оцінюючи навколишню обстановку за допомогою інформації, одержуваної від своїх органів почуттів, вимірювальних приладів, інших осіб. У багатьох випадках цієї інформації недостатньо для однозначної оцінки обстановки. Тоді людина використовує свій досвід, свої знання, пам'ять, інтуїцію. Чудовою властивістю людини є здатність приймати рішення в умовах значної невизначеності відносно навколишньої обстановки. Однак в умовах сучасних великих промислових підприємств знань і інтуїції навіть у досвідченого керівника недостатньо, щоб здійснювати ефективне управління. У результаті використовують математичні методи, тобто методи математичного програмування.

Управлінням називають цілеспрямований вплив на систему з метою отримати найкращий ефект. Можна сказати, що управління є такою організацією того або іншого процесу, що забезпечує досягнення певних цілей.

Можна виділити чотири етапи, характерні для будь-якого процесу управління: поява цілі, оцінка ситуації, ухвалення рішення й виконання ухваленого рішення. Оскільки етап появи цілі передує початку процесу управління, його можна виключити з розгляду. Врахуємо також, що при управлінні складними процесами оцінка ситуації провадиться на основі зібраної й обробленої інформації, таким чином, дістанемо наступні три етапи процесу управління: збір і обробка інформації з метою оцінки сформованої ситуації; ухвалення рішення про найбільш доцільні дії; виконання ухваленого рішення.

Управління завжди вимагає визначення деякої ознаки (або критерію), що дозволяє оцінити ефективність прийнятого рішення, і який пояснює ступінь відповідності поведінки системи цілям управління.

Помітимо, що визначень ефективності багато. Часто ефективність визначають як умову, за якої система збільшить доходи при постійних або менших витратах або буде мати постійний прибуток при менших витратах та ін. Загалом, ефективність можна уявити як кращий (необхідний) результат функціонування системи за менший час, при витраті менших ресурсів у довгостроковій і контрольованій перспективі. Уявлення про результат (ціль) має принципові відзнаки. Наприклад, переваги виробничої системи з вкладення ресурсів у нове обладнання, навчання персоналу або в збільшення жалування й розвиток соціальної сфери, або підвищення виплат власникам мають різну ефективність з позицій персоналу, власника, менеджера й стороннього спостерігача. Отже, визначення ефективності пов'язане із системою виражених і прихованих уявлень про її сутність, цілі, місце розташування спостерігача. Тому слід зазначити виняткову складність задачі строгої формалізації критеріїв ефективності.

У багатьох випадках реалізація процесу управління вимагає витрати будь-яких ресурсів: витрат часу, витрати матеріалів, палива, електроенергії. Отже, при виборі способу управління треба говорити не тільки про те, чи досягається поставлена ціль, але й про те, які ресурси доведеться затратити для досягнення

цієї цілі. У цьому випадку завдання управління полягає в тому, щоб з множини рішень, що забезпечують досягнення цілі, вибрати одне рішення, що вимагає найменшої витрати ресурсів. В інших випадках підставою для переваги одного способу управління перед іншим можуть служити інші вимоги: вартість обслуговування, надійність та ін.

Математичний вираз, що дає кількісну оцінку ступеня досягнення цілі управління, називають **критерієм ефективності** управління. Найкращим або оптимальним способом управління буде такий, при якому критерій ефективності досягає **мінімального** або **максимального** значення. При виборі, наприклад, режиму польоту за критерій якості управління можна прийняти або вираз для кількості палива, що витрачають на одиницю шляху, або шлях, на який витрачають одиницю палива. Найекономічнішому, тобто оптимальному, режиму відповідатиме або мінімальне (у першому випадку), або максимальне (у другому випадку) значення критерію.

При розв'язанні задачі управління треба зважати на ту обставину, що управління будь-якою системою завжди піддане різного роду обмеженням, викликаним обмеженістю ресурсів, використовуваних при управлінні, або інших величин, які в силу фізичних особливостей тієї або іншої системи не можуть або не повинні перевищувати деяких меж. Математично обмеження цього виду виражають зазвичай у вигляді систем алгебраїчних рівнянь або нерівностей, що пов'язують змінні, які описують стан системи. Тому особливе місце в методах оптимізації займає критерій оптимізації з обмеженнями. Смысл тут полягає в тому, що відшукується не будь-яке рішення x^* , що обертає критерій ефективності на мінімум, а таке, що задовольняє системі обмежень. Неважко переконатися, що значення умовного екстремуму не може бути меншим за значення абсолютного екстремуму (без обмежень). Задачі оптимізації при наявності обмежень, по суті, призвели до перегляду класичних методів і створенню нових методів, відомих за назвою методів програмування.

Для визначення оптимальної стратегії при наявності конфліктної ситуації, коли інтереси двох сторін протилежні, широко використовують мінімаксний критерій. Так, у військових ситуаціях виграш однієї сторони означає програш іншої. У цьому випадку доводиться вибирати серед гірших для себе стратегій супротивника найменш гіршу, тобто брати максимум по множині стратегій супротивника й мінімум по власних стратегіях. У цьому й полягає мінімаксний критерій, широко використовуваний у теорії ігор. У теорії матричних ігор задають матрицю платежів

$$\|a_{ij}\|, i = \overline{1, m}; j = \overline{1, n}.$$

Кожний з елементів цієї матриці означає платіж супротивникові у випадку, коли він застосовує стратегію j , а наша сторона — стратегію i . Потрібно знайти серед безлічі гірших для нас стратегій супротивника найменш погану, тобто вирішити мінімаксну задачу, знайти $\min_i \max_j a_{ij}$.

Неважко переконатися, що якщо поміняти знаки a_{ij} на зворотні, а це означає заміну програшу нашої сторони на виграш, то вирішуватиметься максимінна задача знаходження $\max_i \min_j (-a_{ij})$.

У деяких задачах, що мають так звану *сідлову точку*, $\min_i \max_j a_{ij} = \max_i \min_j a_{ij}$.

Обидві ці задачі оптимізації - мінімаксна й максимінна – не вирішуються класичними методами.

Задачу управління можна вважати сформульованою математично, якщо сформульовано ціль управління, виражену через критерій ефективності й визначені обмеження, що представляють собою систему алгебраїчних рівнянь або нерівностей, які виражають обмеженість ресурсів або інших величин, використовуваних при управлінні.

Рішення про спосіб управління, що задовольняє всім поставленим обмеженням і перетворює на мінімум (максимум) критерій ефективності, називають *оптимальним рішенням*.

Отже, суть всіх задач математичного програмування зводиться до пошуку такого розв'язку \bar{X} , що перетворює на екстремум критерій ефективності, виражений як функція від елементів прийнятого розв'язку \bar{X} й називаний *цільовою функцією* $F(x)$. Слід зазначити, що математичне програмування є не аналітичною, а алгоритмічною формою розв'язання задач, тобто дає не формулу, яка виражає остаточний результат, а вказує лише обчислювальну процедуру, що приводить до розв'язання задачі. Тому методи математичного програмування стають ефективними головним чином при використанні обчислювальної техніки.

Відзначимо, що до задач математичного програмування, як правило, не застосовні методи класичного аналізу для відшукування умовних екстремумів. Це пов'язане з їх наступними специфічними особливостями:

- 1) коли на елементи розв'язку \bar{X} накладені обмеження, екстремум часто досягається не в точках, де похідні дорівнюють нулю, а на границі області обмежень;
- 2) у практичних задачах число змінних і число обмежень настільки велике, що пошук екстремуму шляхом визначення похідних стає не ефективним;
- 3) у багатьох задачах математичного програмування цільова функція взагалі не має похідних (наприклад, задана тільки для цілочислових значень аргументів).

У зв'язку із цим метою математичного програмування є створення аналітичних методів визначення розв'язку або ефективних обчислювальних способів одержання наближеного розв'язку.

Математичне моделювання економічних процесів є, з одного боку, дуже важливим і складним, а з іншого боку – таким, що практично не піддається науковій формалізації. Неодноразові спроби виділити загальні принципи створення математичних моделей приводили або до декларування рекомендацій самого загального характеру, важко застосовних для розв'язання конкретних проблем, або, навпаки, до появи рецептів, застосовних у дійсності тільки до вузького ко-

ла задач. Тому кориснішим представляється знайомство з технікою математичного моделювання на конкретних прикладах. Як такі приклади розглянемо кілька класичних економіко-математичних моделей.

Управління портфелем активів. Розглянемо проблему прийняття інвестором рішення про вкладення наявного капіталу. У таблиці показані характеристики об'єктів для інвестування:

Найменування	Прибутковість (%)	Термін викупу (рік)	Надійність (бали)
A	5,5	2011	5
B	6,0	2015	4
C	8,0	2020	2
D	7,5	2012	3
E	5,5	2010	5
F	7,0	2013	4

При ухваленні рішення про придбання активів повинні бути дотримані умови:

- а) сумарний обсяг капіталу, що припускається вкласти, становить 100000 грн;
- б) частка коштів, що вкладена в один об'єкт, не може перевищувати чверті від усього обсягу;
- в) більш за половину всіх коштів повинні бути вкладені у довгострокові активи (припустимо, на розглянутий момент до таких належать активи з терміном погашення після 2014 р.);
- г) частка активів, що мають надійність меншу за 4 бали, не може перевищувати третини від сумарного об'єму.

Складемо математичну модель для цього завдання. Доцільно почати з визначення структури керованих змінних. У розглянутому прикладі як такі змінні виступають обсяги коштів, що вкладені в активи тієї або іншої фірми. Позначимо їх $x_A, x_B, x_C, x_D, x_E, x_F$. Тоді сумарний прибуток від розміщених активів, що отримає інвестор, можна записати у вигляді виразу

$$P = 0,055x_A + 0,06x_B + 0,08x_C + 0,075x_D + 0,055x_E + 0,07x_F. \quad (1.1)$$

На наступному етапі моделювання треба формально описати обмеження а-г на структуру портфеля.

а. Обмеження на сумарний об'єм активів:

$$x_A + x_B + x_C + x_D + x_E + x_F \leq 100000. \quad (1.2)$$

б. Обмеження на розмір частки кожного активу:

$$\begin{aligned} x_A &\leq 25000; x_B \leq 25000; x_C \leq 25000, \\ x_D &\leq 25000, x_E \leq 25000, x_F \leq 25000. \end{aligned} \quad (1.3)$$

в. Обмеження, пов'язане з необхідністю вкласти половину коштів у довгострокові активи:

$$x_B + x_C \geq 50000. \quad (1.4)$$

г. Обмеження на частку ненадійних активів:

$$x_C + x_D \leq 30000. \quad (1.5)$$

Система обмежень відповідно до економічного змісту задачі повинна бути доповнена умовами невід'ємності для змінних:

$$x_A \geq 0; x_B \geq 0; x_C \geq 0; x_D \geq 0; x_E \geq 0; x_F \geq 0. \quad (1.6)$$

Вирази (1.1)-(1.6) утворюють математичну модель поведінки інвестора. У рамках цієї моделі ставиться задача пошуку таких значень змінних $x_A, x_B, x_C, x_D, x_E, x_F$, при яких досягається найбільше значення доходу (1.1) і виконуються обмеження на структуру портфеля активів (1.2)-(1.6).

Розглянемо загальніші моделі й задачі.

Найпростіша задача виробничого планування. Нехай є виробниче підприємство, що виробляє продукцію n видів. У процесі виробництва використовують m видів ресурсів (сировини). Технології виробництва характеризуються нормами витрат сировини на одиницю виробленого продукту. Позначимо через a_{ij} кількість i -го ресурсу ($i = \overline{1-m}$), що витрачають на виробництво одиниці j -го продукту ($j = \overline{1-n}$). Весь набір витрат ресурсів на виробництво j -го продукту можна подати у вигляді вектора-стовпця

$$\bar{A}_j = \begin{bmatrix} a_{1j} \\ a_{2j} \\ \vdots \\ a_{mj} \end{bmatrix},$$

а витрати ресурсів на виробництво всіх n видів продукції - у вигляді прямокутної матриці розмірності m на n :

$$\bar{A} = \begin{bmatrix} a_{11} & \dots & a_{1j} & \dots & a_{1n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{21} & \dots & a_{2j} & \dots & a_{2n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{m1} & \dots & a_{mj} & \dots & a_{mn} \end{bmatrix}.$$

Якщо j -й продукт виробляють в кількості x_j , то ми повинні витратити $a_{1j}x_j$ першого ресурсу, $a_{2j}x_j$ — другого, і так далі, $a_{mj}x_j$ — m -го ресурсу. Зведений план виробництва за всіма продуктами можна представити у вигляді n -мірного вектора-рядка $x = (x_1, x_2, \dots, x_j, \dots, x_n)$. Тоді загальні витрати i -го ресурсу на виробництво всіх продуктів можна виразити у вигляді суми

$$\sum_{j=1}^n a_{ij} x_j,$$

що є скалярним добутком векторів A_j , і x . Очевидно, що всяка реальна виробнича система має обмеження на ресурси, які вона витрачає в процесі виробництва. У рамках розглянутої моделі ці обмеження породжуються m -мірним вектором $b = (b_1, b_2, \dots, b_m)$, де b_i — максимальна кількість i -го ресурсу, яку можна витратити у виробничому процесі. У математичній формі ці обмеження представляють у вигляді системи m нерівностей:

[illegible]

Застосовуючи правила матричної алгебри, систему (1.7) можна записати в короткій формі, уявивши ліву частину як добуток матриці A на вектор X , а праву - як вектор B :

$$\overline{AX} \leq \overline{B}. \quad (1.8)$$

До системи (1.8) також треба додати природні обмеження на невід’ємність компонентів плану виробництва: $x_1 \geq 0$; $x_i \geq 0$; $x_n \geq 0$, або, що те саме,

$$\overline{X} \geq 0. \quad (1.9)$$

Позначимо через c_j ціну одиниці j -го продукту та дістанемо вираз сумарного доходу від виконання плану виробництва, що задається вектором X :

$$\sum_{j=1}^n c_j x_j = \overline{CX}. \quad (1.10)$$

Формули (1.8)—(1.10) є найпростішою математичною моделлю, яка описує окремі сторони функціонування деякого економічного об'єкта, поведінкою якого ми хочемо управляти. У рамках даної моделі можна поставити різні задачі, але найприроднішою буде задача пошуку такого плану виробництва $x \in R^n$, що дає найбільше значення сумарного доходу, тобто функції (1.10), і одночасно задовольняє системі обмежень (1.8)-(1.9).

Незважаючи на явну умовність розглянутої ситуації й простоту задачі, її розв'язання є далеко не тривіальним і багато в чому стало практично можливим тільки після розробки спеціального математичного апарата. Істотною перевагою використовуваних методів розв'язання є їх універсальність, оскільки до отриманої моделі можуть бути зведені дуже багато як економічних, так і неекономічних проблем.

Оскільки будь-яка наукова модель містить спрощуючі передумови, для коректного застосування отриманих за її допомогою результатів необхідно чітко розуміння суті цих спрощень, що, в остаточному підсумку, і дозволяє зробити висновок про їх припустимість або неприпустимість. Найбільш «сильним» спрощенням у розглянутій моделі є припущення про прямо пропорційну (ліній-

ну) залежність між обсягами витрати ресурсів і обсягами виробництва, що задається за допомогою норм витрат a_{ij} . Очевидно, що це допущення далеко не завжди виконується. Так, обсяги витрати багатьох ресурсів (наприклад, основних фондів) змінюються стрибкоподібно залежно від зміни компонентів обсягу виробництва x . До інших передумов, що спрощують, належать припущення про незалежність цін c_j від обсягів x_j , що справедливо лише для певних меж їх зміни, зневага ефектом кооперації в технологіях та ін. Ці «уразливі» місця важливо знати ще й тому, що вони вказують принципові напрямки вдосконалювання моделі.

Транспортна задача. Розглянемо проблему організації перевезення деякого продукту між пунктами його виробництва, кількість яких дорівнює m , і n пунктами споживання. Кожний i -й пункт виробництва ($i = \overline{1, m}$) характеризується запасом продукту $a_i \geq 0$, а кожний j -й пункт споживання ($j = \overline{1, n}$) — потребою в продукті $b_j \geq 0$. Сітку доріг, що з'єднує систему розглянутих пунктів, моделюють за допомогою матриці C розмірності m на n , елементи якої c_{ij} є нормами витрат на перевезення одиниці вантажу з пункту виробництва i до пункту споживання j . План перевезення вантажу подають у вигляді масиву елементів розмірності $m \times n$:

$$x = (x_{11}, \dots, x_{1n}, x_{21}, \dots, x_{2n}, \dots, x_{i1}, \dots, x_{in}, \dots, x_{m1}, \dots, x_{mn}) \quad (1.11)$$

В (1.11) план перевезень x можна розглядати як вектор, що розпадається на m груп, по n елементів у кожній, причому i -я група відповідає об'ємам вантажу, що вивозиться з i -го пункту виробництва до усіх можливих пунктів споживання. Якщо реальне перевезення між пунктами i і j відсутнє, то вважають $x_{ij} = 0$.

Обмеження на можливі значення $x \in R^{mn}$ мають вигляд:

1. Обмеження на задоволення потреб у всіх пунктах споживання:

$$\sum_{i=1}^m x_{ij} \geq b_j, \quad j = \overline{1, n} \quad (1.12)$$

2. Обмеження на можливості вивозу запасів із всіх пунктів виробництва:

$$\sum_{j=1}^n x_{ij} \leq a_i, \quad i = \overline{1, m} \quad (1.13)$$

3. Умови незаперечності компонентів вектора плану:

$$x_{ij} \geq 0, \quad i = \overline{1, m}, \quad j = \overline{1, n}. \quad (1.14)$$

Істотною характеристикою описуваної моделі є співвідношення параметрів a_i і b_j . Якщо сумарний обсяг виробництва дорівнює сумарному обсягу споживання,

$$\sum_{i=1}^m a_i = \sum_{j=1}^n b_j,$$

систему називають **збалансованою**. При цьому розумно накладати такі обмеження на сумарний ввіз і вивіз вантажу, при яких повністю вивозиться весь ва-

нтаж і не залишається незадоволених потреб, тобто умови (1.12) і (1.13) виконуються як рівності.

За аналогією із задачею виробничого планування припустимо, що витрати на перевезення прямо пропорційні кількості перевезеного вантажу. Тоді сумарні витрати на перевезення в системі матимуть вигляд:

$$f(x) = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n c_{ij} x_{ij} . \quad (1.15)$$

Функція (1.15) і описані вище обмеження задають транспортну модель. На її основі можна сформулювати задачу мінімізації сумарних витрат на перевезення, що у літературі одержала назву **транспортної задачі в матричній постановці**. Загалом кажучи, транспортна задача є окремим випадком найпростішої задачі виробничого планування, але в силу ряду особливостей для її розв'язання застосовують специфічні методи, які, крім того, дозволяють прийти до важливих теоретичних узагальнень.

Спільним для розглянутих вище задач являється те, що в них стоїть проблема пошуку найбільшого або найменшого (**оптимального**) значення деякої функції, що відбиває **ціль управління** системою, або **цільової функції**. Пошук оптимального значення здійснюється на деякій підмножині припустимих значень змінних, що описують стан цієї системи, іменованій **множиною припустимих планів**.

Нехай на деякій множині D визначена функція $f(x)$. Нагадаємо, що точку x^* , яка належить D ($x^* \in D$), називають **точкою глобального максимуму**, якщо для будь-якого $x \in D$ виконується нерівність $f(x) \leq f(x^*)$. У цьому випадку значення $f(x^*)$ називають **глобальним максимумом функції**. Точку x називають **точкою локального максимуму**, якщо існує деяке оточення цієї точки, у будь-якій точці якого значення функції менші, чим в x ($f(x) \leq f(x)$). Аналогічно визначають **глобальний і локальний мінімуми**. Узагальнюючим поняттям для максимуму й мінімуму є такий термін, як **екстремум (оптимум)**.

Необхідно відзначити, що далеко не завжди весь комплекс цілей і задач, що стоїть перед об'єктом моделювання, можна виразити у формі деякої цільової функції. Більш того, усвідомлення й осмислення цієї проблеми стало свого роду переломним етапом в історії розвитку даної науки, що дали поштовх до розвитку нових напрямків, пов'язаних з методами **багатокритеріальної (або векторної) оптимізації**, коли критерієм оптимальності є вимога мінімізації або максимізації кількох скалярних функцій. Однак всі вони базуються на методах **однокритеріальної оптимізації**, без ясного розуміння яких неможлива робота з складнішим математичним апаратом.

Потужним інструментом вирішення подібного роду задач стали спеціальні методи пошуку екстремуму, що складають зміст математичного програмування. У цьому випадку поняття програмування вживається в значенні планування (на відміну від програмування для ЕОМ).

Задачі математичного програмування мають велику розмаїтість. Математичне моделювання подібних задач практично не піддається науковій формалі-

зації через те, що принцип побудови математичної моделі істотно залежить від конкретної природи досліджуваної системи. Однак у цих задачах прийнято виділяти деяку послідовність етапів дослідження:

1. Постановка задачі.
2. Словесне формулювання задачі з визначенням цілі її розв'язання й факторів-обмежень, що впливають на нього (вербальна модель);
3. Формалізація задачі – побудова адекватної математичної моделі. На цьому етапі цільову функцію $F(x)$ виражають як залежність від розв'язку \bar{X} , а обмеження записують у вигляді системи рівностей і нерівностей;
4. Розв'язання задачі на базі математичної моделі;
5. Перевірка отриманих результатів на їх адекватність природі досліджуваної системи, можливе коректування первісної моделі.
6. Розробка рекомендацій на підставі отриманого розв'язку.

Введемо ряд визначень.

Розв'язком (або **планом**) називають всякий певний вибір залежних від нас параметрів. Параметри, сукупність яких утворює розв'язок, називають **елементами розв'язку**. Як елементи розв'язку можуть фігурувати числа, вектори, функції, фізичні ознаки та ін.

$$x = (x_1, x_2, \dots, x_j, \dots, x_n).$$

Система обмежень за ресурсами формує множину припустимих розв'язків (планів) D . Той факт, що розв'язок x належить множині припустимих розв'язків D , записують в такий спосіб:

$$x \in D.$$

Оптимальним розв'язком або **оптимальним планом** називають такий розв'язок, що обертає цільову функцію $F(x)$ на максимум або мінімум.

Отже, у найзагальнішому вигляді задачу математичного програмування формують в такий спосіб:

При заданих обмеженнях знайти такий розв'язок $x = x^*$, що обертає цільову функцію $F(x)$ на максимум або мінімум.

$$F^* = \underset{x \in D}{extr}\{F(x, \alpha)\},$$

де α - система обмежень задачі.

Залежно від вигляду цільової функції $F(x)$ і системи обмежень α у математичному програмуванні виділяють наступні методи.

Лінійне програмування. Застосовують, якщо в моделі цільова функція $F(x)$ є лінійною, а множину D , на якій шукають її екстремум, задано системою лінійних рівностей і нерівностей. У лінійному програмуванні існує клас задач, структура яких дозволяє створити спеціальні методи розв'язання, що вигідно відрізняються від методів розв'язання задач загального характеру. Зокрема - транспортна задача.

Нелінійне програмування. Тут є нелінійними цільова функція й обмеження. У нелінійному програмуванні виділяють такі класи задач:

- **опукле програмування** – коли цільова функція є опуклою (якщо розглядають задачу її мінімізації) і є опуклою множина, на якій вирішують екстремальну задачу;

- **квадратичне програмування** – коли цільова функція є квадратичною, а обмеження – лінійними рівностями або нерівностями.

Дискретне програмування. Даний метод використовують, коли на елементи рішення x накладено вимогу дискретності, наприклад, цілочисловості. Така вимога істотно ускладнює розв'язання задачі, тому що застосування стандартних прийомів (вирішити задачу як аналогову, а потім округлити результат до цілого значення) неможливе.

Динамічне програмування. Це метод, що дозволяє шляхом покрокової оптимізації деяких проміжних цільових функцій отримати загальний результуючий оптимум. У задачах динамічного програмування цільова функція $F(x)$ є адитивною або мультиплікативною функцією змінних x .

Стохастичне програмування. Цей вид програмування використовують, коли параметри умов або елементи розв'язку є випадковими величинами, що зумовлено невизначеністю, яка породжує ризикованість прийнятих рішень. У стохастичному програмуванні труднощі виникають не тільки при розробці методів розв'язання задач, а й при їх постановці.

Евристичне програмування. Застосовують для розв'язання задач, у яких точний оптимум знайти алгоритмічним шляхом неможливо через величезне число варіантів. У такому випадку відшукують не оптимальний, а досить гарний з погляду практики розв'язок.

Контрольні запитання

1. Охарактеризуйте предмет і зміст науки «Математичне програмування».
2. Охарактеризуйте особливості задач математичного програмування.
3. Які загальні етапи розв'язання задач математичного програмування прийнято виділяти?
4. Чому до задач математичного програмування, не застосовують класичні методи пошуку умовного екстремуму функції?
5. Що являє собою цільова функція задачі математичного програмування? Яке її призначення?
6. Дайте визначення понять: план, припустимий план, оптимальний план, розв'язок задачі.
7. На чому базується класифікація моделей і методів розв'язання задач математичного програмування? Які класи моделей і методів виділяють у математичному програмуванні?
8. Що являє собою множина можливих розв'язків задачі математичного програмування?
9. Поясніть, яку область можливих розв'язків задачі математичного програмування називають областю припустимих планів.

TEMA 2.

ЛІНІЙНЕ ПРОГРАМУВАННЯ

Серед задач математичного програмування найпростішими й найкраще розробленими є задачі лінійного програмування. Характерно для них те, що:

- цільова функція $F(x)$ лінійно залежить від елементів розв'язку x_1, x_2, \dots, x_n . Її називають **лінійною формою** й позначають L ;
- обмеження, що накладають на елементи розв'язку, мають вигляд лінійних рівностей і нерівностей щодо $x_1, x_2, \dots, x_1, \dots, x_n$.

Такі задачі часто зустрічаються на практиці. До задач лінійного програмування належить, зокрема, розглянута раніше найпростіша задача виробничого планування (задача про оптимальне використання ресурсів). Також до задач лінійного програмування належать задачі про використання інвестицій, про мінімізацію витрат, транспортна задача, задача про складання раціону та ін.

Математичну модель задачі лінійного програмування завжди записують у двох формах – у *загальній формі* (ЗЗЛП) і *канонічній формі* (КЗЛП).

2.1. Загальна форма задачі лінійного програмування (ЗЛП)

У загальному вигляді задачу лінійного програмування (ЗЛП) формують в такий спосіб:

Знайти найбільше або найменше значення лінійної функції

$$L = \sum_{j=1}^n c_j x_j \rightarrow extr. \quad (2.1)$$

на деякій множині D , де $x \in D$ задовольняє системі обмежень

$$\begin{aligned}
& a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n \leq b_1 \\
& a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n \leq b_2 \\
& \dots\dots\dots \\
& a_{k1}x_1 + a_{k2}x_2 + \dots + a_{kn}x_n \leq b_k \\
& a_{(k+1)1}x_1 + a_{(k+1)2}x_2 + \dots + a_{(k+1)n}x_n = b_{(k+1)} \\
& \dots\dots\dots \\
& a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = b_m \\
& x_j \geq 0, \quad j = \overline{1, n}
\end{aligned} \tag{2.2}$$

Відзначимо, що в системі перші k обмежень є нерівностями, а наступні $m-k$ - рівняннями. Цього можна домогтися простим переупорядкуванням виразів.

Щодо напрямку знака нерівності вважатимемо, що ліва частина менша або дорівнює правій частині. Домогтися цього можна, помноживши на (-1) обидві частини нерівностей із протилежним знаком.

Вибір типу шуканого екстремуму цільової функції також не принциповий, оскільки задача пошуку максимуму функції $L = \sum c_j x_j$ є еквівалентною задачі пошуку мінімуму функції $-L = \sum (-c_j x_j)$.

Задачу лінійного програмування, записану в такій формі, називають загальною задачею лінійного програмування (ЗЗЛП).

2.2. Основні властивості ЗЗЛП та її перша геометрична інтерпретація

2.2.1. Основні поняття лінійної алгебри й опуклого аналізу, застосовувані в теорії математичного програмування.

Коротко нагадаємо деякі фундаментальні визначення й теореми лінійної алгебри й опуклого аналізу, які широко застосовують при розв'язанні задач як лінійного, так і нелінійного програмування.

Фундаментальним поняттям лінійної алгебри є лінійний (речовинний) простір. Під ним мають на увазі множину деяких елементів (іменованих векторами або точками), для яких задані операції додавання й множення на речовинне число (скаляр), причому елементи, що є результатом виконання операцій, також відповідно до визначення повинні належати вихідному простору.

Окремими випадками лінійних просторів є речовинна пряма, площина, геометричний тривимірний простір.

Вектор $\lambda_1 a_1 + \lambda_2 a_2 + \dots + \lambda_m a_m$ називають **лінійною комбінацією** векторів a_1, a_2, \dots, a_m з коефіцієнтами $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_m$.

Систему векторів лінійного простору a_1, a_2, \dots, a_m називають **лінійно залежною**, якщо існують такі числа $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_m$, що дорівнюють одночасно нулю, що їх лінійна комбінація $\lambda_1 a_1, \lambda_2 a_2, \dots, \lambda_m a_m$ дорівнює нульовому вектору (вектору, усі компоненти якого дорівнюють нулю). У протилежному випадку систему a_1, a_2, \dots, a_m називають **лінійно незалежною**, тобто лінійна комбінація цих векторів може дорівнювати нульовому вектору тільки при нульових коефіцієнтах $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_m$.

Максимально можлива кількість векторів, які можуть утворювати лінійно незалежну систему в даному лінійному просторі, називають **розмірністю простору**, а будь-яку систему лінійно незалежних векторів у кількості, рівній розмірності, — **базисом простору**.

Лінійний простір позначають R^n , де n — його розмірність.

Будь-яка підмножина даного лінійного простору, що саме має властивості лінійного простору, називають лінійним підпростором. Множину H , одержувану зсувом деякого лінійного підпростору $L \in R^n$ на вектор $a \in R^n$: $H = L + a$, називають афінною множиною (простором). Якщо фундаментальною властивістю будь-якого лінійного простору або підпростору є приналежність йому нульового вектора, то для афінної множини це не завжди так. На площині прикладом підпростору є пряма, що проходить через початок координат, а афінної множини - будь-яка пряма на площині. Характерною властивістю афінної множини є належність їй будь-якої прямої, що з'єднує дві будь-які її точки. Розмірність афінної множини збігається з розмірністю того лінійного підпростору, зсувом якого вона отримана.

Якщо розглядають деякий лінійний простір R^n , то приналежні йому афінні множини розмірності 1 називають прямими, а розмірності $(n - 1)$ — гіперплощинами. Так, звичайна площина є гіперплощиною для тривимірного геометричного простору R^3 , а пряма — гіперплощиною для площини R^2 . Усяка гіперплощина поділяє лінійний простір на два напівпростори.

Множину V векторів (точок) лінійного простору R^n називають **опуклою**, якщо вона містить відрізок прямої, що з'єднує дві його будь-які точки, або, інакше кажучи, з того, що $a \in V$ і $b \in V$, випливає, що $x = (1 - \lambda)a + \lambda b \in V$, де $0 \leq \lambda \leq 1$.

Лінійну комбінацію $\sum_{i=1}^m \lambda_i a_i$ векторів a_1, a_2, \dots, a_m називають **опуклою**,

якщо $\lambda_i \geq 0$, $i = \overline{1, m}$ і $\sum_{i=1}^m \lambda_i = 1$.

Множину, що містить всі можливі опуклі комбінації точок деякої множини M , називають опуклою оболонкою даної множини. Можна показати, що опукла оболонка множини M є найменшою опуклою множиною, що містить M .

Опуклу оболонку кінцевої множини точок називають **опуклим багатогранником**, а непусте перетинання кінцевої кількості замкнутих напівпросторів — **багатогранною опуклою множиною**. На відміну від опуклого багатогранника остання може бути необмеженою.

Точку v опуклої множини V називають її кутовою (крайньою) точкою, якщо вона не є внутрішньою точкою ні для якого відрізка, кінці якого належать множині V . Кутові точки опуклого багатогранника є його вершинами, а сам він — опуклою оболонкою своїх вершин.

2.2.2. Перша геометрична інтерпретація ЗЛП і графічний метод розв'язання.

У тому випадку, коли ЗЛП містить дві змінні x_1 і x_2 , її можна зобразити на координатній площині й одержати розв'язок графічним методом. Графічне розв'язання ЗЛП носить ілюстративний характер, але основний зміст і термінологія розповсюджуються на задачі великої розмірності.

Розглянемо приклад. Нехай цільова функція представлена виразом

$$L = x_1 + 3x_2 \rightarrow \max,$$

а обмеження задані системою нерівностей:

$$x_1 + x_2 \leq 6$$

$$x_1 - x_2 \leq 2$$

$$x_1 \leq 3$$

$$x_1 \geq 0, x_2 \geq 0.$$

Будемо зображувати пару значень x_1 і x_2 точкою на координатній площині $x_1 O x_2$ з координатами (x_1, x_2) , що показано на рис. 2.1.

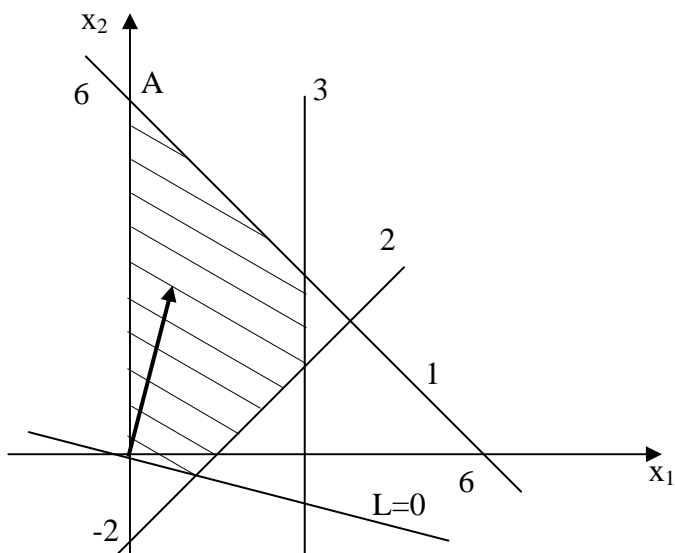


Рис. 2.1 – Геометрична інтерпретація ЗЗЛП

Кожна нерівність визначає деяку напівплощину. Перетинання трьох напівплощин є множиною припустимих планів D , тому що кожна точка його множини належить одночасно кожній із трьох напівплощин, а отже задовольняє обмеженням ЗЗЛП. Помітимо, що припустимих розв'язків - нескінченна множина.

Для визначення оптимального плану задачі, тобто такого розв'язку (x_1, x_2) , що обертає цільову функцію на максимум, скористаємося визначеннями:

- градієнтом функції $f(x)$ називають вектор

$$\nabla f(x) = \left(\frac{\partial f(x)}{\partial x_1}, \dots, \frac{\partial f(x)}{\partial x_n} \right),$$

який вказує напрямок найшвидшого зростання функції $f(x)$;

- лінією рівня функції $f(x)$ називають множину точок з області її визначення, у яких функція приймає те саме фіксоване значення.

У нашому прикладі $\nabla L = (1, 3)$. Лінії рівня L перпендикулярні напрямку градієнта. Побудуємо опорну пряму $L=0$, що проходить через початок координат, і будемо переміщувати її в напрямку ∇L . Очевидно, що переміщати лінію рівня в напрямку зростання цільової функції має сенс тільки в межах області припустимих розв'язків. Точкою, у якій цільова функція дістане максимальне значення, у нашому прикладі є точка A з координатами $(0, 6)$. Отже, отриманий оптимальний план задачі

$$x^* = (0, 6),$$

при якому цільова функція приймає максимальне значення

$$L = 1 \cdot 0 + 3 \cdot 6 = 18.$$

Теоретично можливі також такі окремі випадки розв'язку ЗЗЛП:

- цільова функція L не обмежена зверху, тобто не має максимуму (рис. 2.2);
- коли лінія рівня збігається із гранню області припустимих розв'язків (рис. 2.3). У цьому випадку всі точки, що лежать на грані множини D , є оптимальними планами й кажуть, що має місце *альтернативний оптимум*.

У розглянутих ілюстраціях припустимі плани ЗЗЛП мають вигляд опуклої багатогранної множини. Таке подання множини припустимих планів називають першою геометричною інтерпретацією ЗЗЛП.

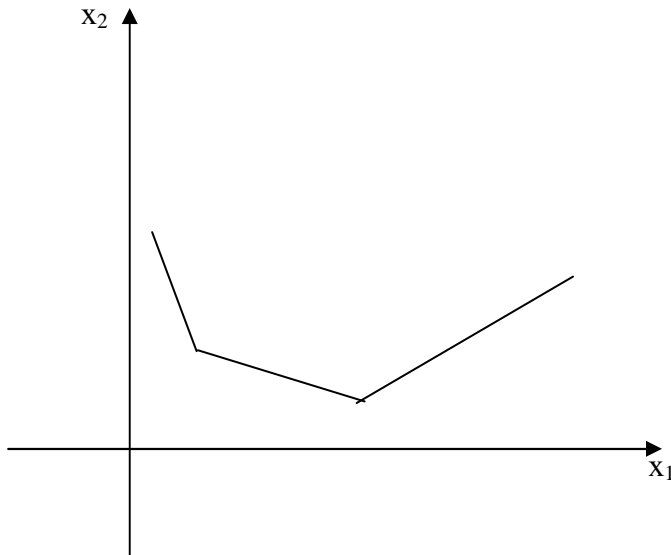


Рис. 2.2 – Цільова функція L не обмежена зверху

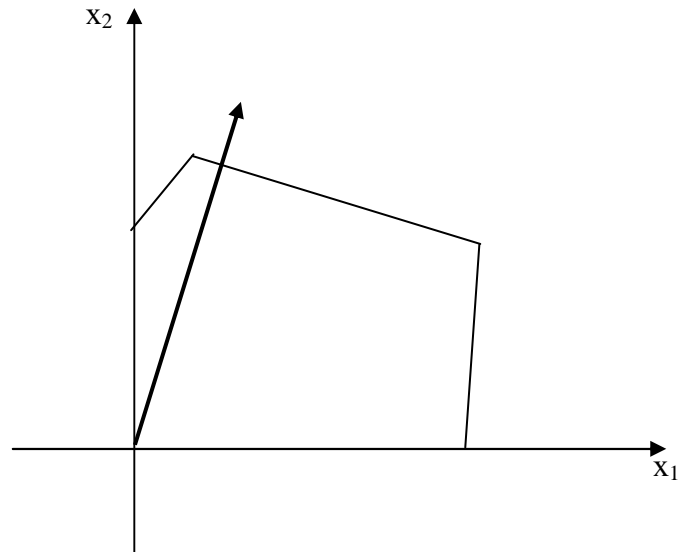


Рис. 2.3 – Альтернативний оптимум

2.2.3. Основні теореми лінійного програмування.

Розглянемо деякі теореми, що відбивають фундаментальні властивості задач лінійного програмування і полягають в основі методів їх розв'язання. Вони узагальнюють на випадок задач із довільною кількістю змінних ті властивості, які ми спостерігали у двовимірному випадку.

Теорема 2.1. Якщо цільова функція L приймає максимальне значення в деякій точці множини припустимих планів D , то вона приймає це значення й у деякій кутовій точці даної множини.

Доказ.

Щоб не ускладнювати виклад, обмежимося тим випадком, коли множина D обмежена, і, отже, є опуклим багатогранником:

Для доказу скористаємося наступною відомою властивістю обмежених опуклих множин:

Якщо D - замкнена обмежена опукла множина, що має кінцеве число кутових точок, то будь-яка точка $x \in D$ може бути поданою у вигляді опуклої комбінації кутових точок D .

Нехай x_1, x_2, \dots, x_m - кутові точки множини D , а x^* - точка, у якій цільова функція L досягає максимуму. Точку x^* можна уявити у вигляді опуклої комбінації кутових точок x_1, x_2, \dots, x_m

$$x^* = \sum_{i=1}^m \lambda_i x_i,$$

де $\sum \lambda_i = 1, \lambda_i \geq 0, i = \overline{1, m}$.

Оскільки x^* - точка максимуму, то для будь-якого x $s x^* \geq s x$. У тому числі й для $s x_r$ (x_r - кутова точка).

Функція $L(x)$ - лінійна, тому

$$L\left(\sum_{i=1}^m \lambda_i x_i\right) = \sum_{i=1}^m \lambda_i L(x_i),$$

а тоді

$$cx^* = c \sum_{i=1}^m \lambda_i x_i = \sum_{i=1}^m \lambda_i (cx_i) \leq \sum_{i=1}^m \lambda_i (cx_r) = cx_r \sum_{i=1}^m \lambda_i = cx_r,$$

де x_r – кутова точка множини D , що задовольняє умові

$$cx_r = \max_{1 \leq i \leq m} \{cx_i\}.$$

Отже, $cx^* \leq cx_r$. У той самий час $cx^* \geq cx_r$, звідки випливає $cx^* = cx_r$.

Тобто існує принаймні одна кутова точка x_r , у якій цільова функція приймає максимальне значення.

Теорема 2.2. Якщо цільова функція L приймає максимальне значення в кількох точках множини D , то вона приймає це саме значення в будь-якій точці, що є їх опуклою комбінацією.

Доказ.

Нехай максимальне значення цільової функції $L(x)$ досягається в точках x_1, x_2, \dots, x_s , тобто $L^* = cx_i$, $i = \overline{1, s}$. Розглянемо довільну опуклу комбінацію цих точок

$$x^* = \sum_{i=1}^s \lambda_i x_i,$$

де $\sum \lambda_i = 1$, $\lambda_i \geq 0$, $i = \overline{1, s}$.

Знайдемо значення цільової функції в точці x^*

$$L(x^*) = cx^* = c \sum_{i=1}^s \lambda_i x_i = \sum_{i=1}^s \lambda_i (cx_i) = \sum_{i=1}^s \lambda_i L^* = L^* \sum_{i=1}^s \lambda_i = L^*.$$

Теорема 2.1 є фундаментальною, тому що вона вказує принциповий шлях розв'язання ЗЛП. Замість дослідження нескінченної множини припустимих розв'язків для знаходження серед них оптимального, необхідно досліджувати лише кінцеве число кутових точок багатогранника розв'язків.

2.3. Канонічна форма задачі лінійного програмування (КЗЛП)

Канонічною називають задачу лінійного програмування, якщо всі її обмеження є рівняннями.

Переважає більшість методів розв'язання задач лінійного програмування призначена для канонічних задач. Тому початковий етап розв'язання будь-якої загальної ЗЛП завжди пов'язаний із приведенням її до еквівалентної КЗЛП.

Загальна ідея переходу від ЗЛП до КЗЛП досить проста. Обмеження у вигляді нерівностей перетворюють на рівняння за рахунок додавання фіктивних невід'ємних змінних, які одночасно входять до цільової функції з коефіцієнтом 0, тобто не надають впливу на її значення.

$$x'_{n+i}, \quad i = \overline{1, k}.$$

Змінні, на які не накладена умова невід'ємності, представляються у вигляді різниці двох нових невід'ємних змінних.

Додатково треба помітити, що вибір типу шуканого екстремуму (максимуму або мінімуму) носить відносний характер. Так, задача пошуку максимуму функції

$$L(x) = \sum_{j=1}^n c_j x_j$$

еквівалентна задачі пошуку мінімуму функції

$$-L(x) = \sum_{j=1}^n -c_j x_j.$$

У результаті таких перетворень одержують канонічну задачу:

Знайти найбільше або найменше значення функції

$$L = z_1 x_1 + z_2 x_2 + \dots + c_n x_n + 0 \cdot x'_{n+1} + \dots + 0 \cdot x'_{n+k} \quad (2.3)$$

на деякій множині D, де $x \in D$ задовольняє системі обмежень

$$a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n + x'_{n+1} = b_1$$

$$a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n + x'_{n+2} = b_2$$

.....

$$a_{k1}x_1 + a_{k2}x_2 + \dots + a_{kn}x_n + x'_{n+k} = b_k$$

$$a_{k+1,1}x_1 + a_{k+1,2}x_2 + \dots + a_{k+1,n}x_n = b_{k+1}$$

.....

$$a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = b_m$$

$$x_j \geq 0, \quad j = \overline{1, n+k}.$$

(2.4)

Можна показати, що отримана задача еквівалентна вихідній задачі.

Отже, «платою» за перехід від загальної форми задачі лінійного програмування до канонічної є зростання її розмірності, що, за інших рівних умов, ускладнює процес розв'язання.

2.3.1. Базисні розв'язки канонічної задачі лінійного програмування

Запишемо КЗЛП у матричній формі:

знайти максимум

$$\overline{C}^T \overline{X} \quad (2.5)$$

за умови

$$\overline{A}^T \overline{X} = \overline{B}, \quad \overline{X} \geq 0, \quad (2.6)$$

де \overline{A} , \overline{X} і \overline{B} – вектори.

$$\overline{A}_1 = \begin{pmatrix} a_{11} \\ a_{21} \\ \vdots \\ a_{m1} \end{pmatrix}; \quad \overline{A}_2 = \begin{pmatrix} a_{12} \\ a_{22} \\ \vdots \\ a_{m2} \end{pmatrix}; \quad \overline{A}_n = \begin{pmatrix} a_{1n} \\ a_{2n} \\ \vdots \\ a_{mn} \end{pmatrix}; \quad \overline{B} = \begin{pmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_m \end{pmatrix}. \quad (2.7)$$

Будемо розглядати стовпці матриці \bar{A}_j як вектори простору R^m . Тоді кожному припустимому плану КЗЛП (n-мірному вектору \bar{X}) відповідає лінійна комбінація стовпців \bar{A}_j , рівна стовпцю $\bar{B} \in R^m$.

Вектори \bar{A}_j , $j = \overline{1, n}$ називають векторами вимог задачі. Вектор \bar{B} називають вектором обмежень. При цьому компоненти деякого припустимого плану $x \in D$ - x_j - є коефіцієнтами розкладання вектора обмежень \bar{B} задачі по векторах вимог \bar{A}_j .

Очевидно, що число рівнянь, які задають множину D , менше або дорівнює числу змінних задачі ($m \leq n$). Якщо це не так, то або система рівнянь

$$\bar{A} \bar{X} = \bar{B}$$

є несумісною, або вона містить надлишкові (лінійно залежні) рівняння.

Якщо деякі m стовпців A_1, A_2, \dots, A_m матриці \bar{A} є лінійно незалежними, то вони утворюють *базис* у просторі R^m і їх буде досить для уявлення вектора \bar{B} у вигляді лінійної комбінації зазначених стовпців. Це означає, що інші стовпці ввійдуть у дане розкладання з нульовими коефіцієнтами.

Якщо коефіцієнти лінійної комбінації виявляться невід'ємними, то ми отримаємо *базисний припустимий план* x , в якого не більш за m елементів відмінні від нуля. Або іншими словами. Система обмежень КЗЛП являє собою систему m рівнянь із n змінними, причому $m \leq n$.

У такій системі m змінних називаються *базисними*, а інші $(n - m)$ змінних - *вільними*.

Базисним розв'язком системи m лінійних рівнянь із n змінними називають розв'язок, у якому всі $n - m$ вільних змінних дорівнюють нулю.

Базисними розв'язками можуть бути різні групи з n змінних. У загальному випадку число таких груп не перевершує C_n^m .

Отже, система з m лінійних рівнянь з n змінними ($m < n$) є *невизначеною*, тому що кожному довільному набору вільних змінних відповідає один базисний розв'язок системи.

Опорним планом КЗЛП називають припустимий базисний розв'язок, компоненти якого більші за нуль.

Базисний розв'язок, у якому хоча б одна з базисних змінних дорівнює нулю, називають *виродженням*.

2.3.2. Властивості базисних планів задачі лінійного програмування

Теорема 2.3. Кожний припустимий базисний план є кутовою точкою множини припустимих планів D .

Доказ:

Будемо вважати, що базисними є перші m стовпців матриці \bar{A}

$$A_1, A_2, \dots, A_m \dots$$

Тоді формулювання теореми можна записати у вигляді:

Якщо існує такий n -мірний вектор

$$x = \left(x_1, x_2, \dots, x_k, \underbrace{0, \dots, 0}_{n-k} \right)$$

$$x_j > 0; \quad j = \overline{1, k}; \quad k \leq m,$$

що $x_1 A_1 + x_2 A_2 + \dots + x_k A_k = B_0$, то $x \in$ кутовою точкою множини D .

Припустимо, що базисний план x не є кутовою точкою множини D . У цьому випадку його можна уявити у вигляді опуклої комбінації двох різних припустимих планів x^1 і x^2

$$x = \lambda x^1 + (1 - \lambda) x^2, \quad 0 < \lambda < 1.$$

Оскільки останні $(n-k)$ компонент вектора x дорівнюють нулю, а λ і $(1-\lambda)$ більші за нуль, то ці самі $(n-k)$ компонент у векторах x^1 і x^2 також дорівнюють нулю.

Оскільки плани x^1 і x^2 – припустимі плани,

$$x_1^1 A_1 + x_2^1 A_2 + \dots + x_k^1 A_k = B$$

$$x_1^2 A_1 + x_2^2 A_2 + \dots + x_k^2 A_k = B$$

Віднімемо з першого рівняння друге

$$(x_1^1 - x_1^2) A_1 + (x_2^1 - x_2^2) A_2 + \dots + (x_k^1 - x_k^2) A_k = 0.$$

Отримали нульовий вектор. Оскільки A_j лінійно незалежні, нулю дорівнюють коефіцієнти

$$(x_1^1 - x_1^2) = 0$$

$$(x_2^1 - x_2^2) = 0$$

$$\vdots$$

$$(x_k^1 - x_k^2) = 0$$

Звідки випливає, що $x^1 = x^2$. Це суперечить припущенню, що x^1 і x^2 є різними кутовими точками множини D .

Отже, план x не може бути представлений у вигляді опуклої комбінації двох інших точок множини, і є кутовою точкою даної множини.

Справедливо й зворотнє ствердження: Якщо x – кутова точка множини D , то вона є припустимим базисним планом задачі лінійного програмування.

2.4. Симплекс-метод

На підставі розглянутих теорем про властивості лінійних екстремальних задач можна побачити, що пошук їх розв'язків зводиться до послідовного перебору кутових точок множини припустимих планів.

Однак такий перебір для реальних багатомірних завдань на практиці нездійснений або вкрай неефективний. Наприклад, число базисних планів у задачі з 10 змінними й 30 обмеженнями становить

$$C_{30}^{10} = \frac{30!}{10! \cdot 20!} = 1489411.$$

Класичним методом розв'язання задач лінійного програмування є симплекс-метод, що також називають методом послідовного поліпшення плану. Він розроблений в 1947 році американським математиком Джорджем Данцигом.

Симплекс-метод є послідовним перебором кутових точок області припустимих розв'язків, при якому значення цільової функції зростає від ітерації до ітерації (від однієї кутової точки до іншої).

Критерій оптимальності в симплекс-методі реалізують шляхом визначення спеціальних оцінок Δ_j для небазисних векторів-стовпців матриці \bar{A} , щодо поточного базису (симплекс-різниць). Симплекс-різниці обчислюють за формулою

$$\Delta_j = L_j - c_j, \quad (2.8)$$

де L_j – індекси векторів, що відповідають поточному базису

$$L_j = \sum_{i=1}^m c_j a_{ij}. \quad (2.9)$$

Сформулюємо критерій оптимальності припустимого базисного плану:

план є оптимальним, якщо для всіх $j = \overline{1, n}$ $\Delta_j \geq 0$, і неоптимальним у протилежному випадку, тобто якщо існує таке $j = \overline{1, n}$, що $\Delta_j < 0$.

Якщо симплекс-різниці показують неоптимальність плану, здійснюють перехід до наступного базису. При цьому один стовпець виводиться з базису, а інший вводиться. Для забезпечення покращення значення цільової функції в базис повинен бути введеним вектор-стовпець, що має від'ємну оцінку. Якщо таких стовпців кілька, то для введення рекомендують вибирати стовпець, що має

максимальний за модулем добуток оцінки Δ_j на відношення $\Theta_r = \min_i \left\{ \frac{b_i}{a_{ij}} \right\}$. Од-

ночасно на цьому кроці потрібно ухвалити рішення щодо того, який стовпець треба вивести з базису. Зробити це потрібно так, щоб знову сформований базис опинився припустимим.

Можна довести, що припустимість базису, до якого здійснюють перехід, забезпечується наступним правилом виводу стовпця з поточного базису:

для стовпця, що претендує на введення до базису, і вектора обмежень \bar{B} розглядають відношення

$$\Theta_i = \frac{b_i}{a_{ij}}. \quad (2.10)$$

і визначають такий рядок r , що

$$\Theta_r = \min_i \{ \Theta_i \}. \quad (2.11)$$

Отриманий індекс r визначає номер рядка, який відповідає вектору, виведеному з базису.

Отже, якщо базис на q -ї ітерації включав стовпці з номерами

$$\{j_1, j_2, \dots, j_{r-1}, j_r, j_{r+1}, \dots, j_m\},$$

то базис на ітерації $q + 1$ буде складатися зі стовпців з номерами:

$$\{j_1, j_2, \dots, j_{r-1}, j_{r+1}, \dots, j_m\}.$$

Окремо слід домовитися про випадок, коли стовпець, що претендує на введення до базису, не містить додатних компонентів ($a_{ij} < 0$). Це означає, що цільова функція в задачі не обмежена на множині припустимих значень, тобто може досягати як завгодно великого значення, отже оптимальний план відсутній.

Після переходу до нового базису можна заново сформувати матрицю \bar{A} й дослідити новий план на оптимальність. З погляду техніки обчислень раціонально безпосередньо переходити від матриці q -ї ітерації до матриці $(q+1)$ -ї ітерації. Справа в тому, що в цих матрицях стовпці, які відповідають базисним векторам, складаються з нулів, за винятком одного елемента, що дорівнює одиниці. Позиція цього ненульового (одиничного) елемента визначається порядковим номером базисного стовпця. Тому для одержання матриці $(q+1)$ -ї ітерації досить за допомогою лінійних операцій над рядками матриці q -ї (попередньої) ітерації привести її стовпець, що відповідає вектору, який вводиться до базису, до «базисного» вигляду.

Для цього застосовують перетворення Жордана-Гаусса (так званий метод повного виключення). У цьому випадку воно полягає в тому, що ми повинні дістати одиницю на місці елемента a_{rj} (його зазвичай називають ведучим) і нулі на місці інших елементів стовпця a_{ij} . Перше досягається за допомогою поділення r -го рядка на ведучий елемент, друге - шляхом додавання знову отриманого r -го рядка, помноженого на відповідний коефіцієнт, до інших рядків матриці q -ї (попередньої) ітерації.

Формально результат виконання даного перетворення над елементами матриці може бути виражений у наступному виді:

$$a_{rj}^{q+1} = \frac{a_{rj}^q}{a_{rk}^q}, \quad b_r^{q+1} = \frac{b_r^q}{a_{rk}^q}, \quad (2.12)$$

де $j = \overline{1, n}$; k – номер стовпця, що вводиться до базису;

$$a_{ij}^{q+1} = a_{ij}^q - a_{ik}^q \frac{a_{rj}^q}{a_{rk}^q}, \quad (2.13)$$

де $i = \overline{1, m}$, $i \neq r$;

$$b_i^{q+1} = b_i^q - a_{ik}^q \frac{b_r^q}{a_{rk}^q}, \quad (2.14)$$

де $i = \overline{1, m}$, $i \neq r$.

Слід особливо зазначити зміст елементів вектора \bar{B} . Його нульовий компонент b_0 містить значення цільової функції, що досягається нею на поточному плані, а інші елементи — ненульові компоненти цього плану.

Приведемо схему алгоритму симплекс-методу для розв'язання задачі максимізації.

1. Знаходять припустимий базисний план.

2. Перевіряють оптимальність поточного базисного плану: здійснюють перегляд рядка оцінок Δ_j . Можливі два варіанти:

- $\Delta_j \geq 0$ — план, що відповідає поточному базису задачі, оптимальний. Обчислювальний процес закінчений. Виписують оптимальний план задачі x^* і значення цільової функції $L(x^*)$.

- у рядку оцінок Δ_j існує щонайменше один елемент $\Delta_j < 0$, тобто оцінка якого є від'ємною. Отже, план неоптимальний. Вибирають стовпець із номером k , для якого добуток $\Delta_j \theta$ є найбільшим за абсолютною величиною. Він називається ведучим і повинен бути введений до чергового базису

3. Визначають стовпець, що треба вивести з базису. Досліджують ведучий стовпець, можливі два варіанти:

- для всіх $i = \overline{1, m}$ $a_{ik}^q < 0$. Роблять висновок про необмеженість цільової функції й завершують обчислювальний процес.

- існує принаймні один рядок з номером $i = \overline{1, m}$, для якого $a_{ik}^q > 0$. Відповідно до правила (2.11) визначають номер r стовпця, виведеного з базису.

4. Перераховують елементи матриці \bar{A} й стовпця \bar{B} щодо нового базису відповідно до формул (2.12)-(2.14). Переходять до пункту 2 алгоритму.

Таблична реалізація симплекс-методу. З погляду забезпечення раціональності й наочності обчислювального процесу виконання алгоритму симплекс-методу зручно оформляти у вигляді послідовності таблиць. У різних джерелах наводять різні модифікації симплекс-таблиць, що відрізняються одна від одної розташуванням окремих елементів. Однак всі вони базуються на тих самих принципах. Зупинимося на наступній структурі таблиці:

Базис	$C_{\text{баз}}$	C_j					
		B	A_1	A_2	A_j	...	A_n
A_j							
L_j							
Δ_j							

Стовпець «Базис» містить найменування базисних векторів (у тій послідовності, у якій вони входять до базису), стовпець $C_{\text{баз}}$ — містить коефіцієнти цільової функції при базисних змінних, стовпець B — компоненти вектора обмежень щодо поточного базису, A_1 - A_n — компоненти матриці задачі щодо поточного базису. У рядку L_j записують індекси, визначені за формулою (2.9)

У рядку Δ_j містяться поточні оцінки стовпців. Рядок C_j містить коефіцієнти при компонентах поточного плану в цільовій функції.

Слід зазначити, що таблична модифікація симплекс-методу має важливе практичне значення не стільки як зручна форма організації ручного рахунку, скільки як основа для реалізації цього алгоритму в рамках програмного забезпечення ЕОМ.

Розглянемо приклад розв'язання ЗЛП за симплекс-методом. Нехай дана канонічна задача ЛП:

$$L(x) = 50x_1 - 10x_2 + 6x_3 + 40x_4 - 30x_5 \rightarrow \max$$

$$x_1 + x_4 + 3x_5 = 12,$$

$$2x_1 + x_2 + 3x_4 = 14,$$

$$-2x_1 + 3x_3 - 4x_4 = 17,$$

$$x_1 > 0, x_2 > 0, x_3 > 0, x_4 > 0, x_5 > 0.$$

Як видно, стовпці матриці з номерами {5, 2, 3} є лінійно незалежними. І можна одержати розкладання по цих стовпцях вектора обмежень із додатними коефіцієнтами. Останнє означає, що стовпці {5, 2, 3} утворюють припустимий базис, з якого можна почати розв'язання задачі. Початковий опорний план має вигляд $x^1 = \{0, 14, 17/3, 0, 4\}$. Заповнюємо симплекс-таблицю, що відповідає першій ітерації ($q=1$).

Базис	$C_{\text{баз}}$	C_j	50	-10	6	40	-30
		B	A_1	A_2	A_3	A_4	A_5
A_2	-10	14	2	1	0	3	0
A_3	6	17/3	-2/3	0	1	-4/3	0
A_5	-30	4	1/3	0	0	1/3	1
L_j		-226	-34	-10	6	-48	-30
Δ_j			-84	0	0	-88	0

Оскільки рядок оцінок у першому й четвертому стовпцях містить від'ємні елементи $\Delta_1 = -84$, $\Delta_4 = -88$, план $x^1 = \{0, 14, 17/3, 0, 4\}$ не є оптимальним, і значення цільової функції $L(x^1) = -226$ можна покращити. Перейдемо до нового опорного плану.

Визначимо вектор, що будемо вводити до базису (A_1 або A_4).

Відповідно до алгоритму симплекс-методу визначимо відношення Θ . Для вектора A_1 : $\Theta_r = \min \left\{ \frac{14}{2}; \frac{4}{1/3} \right\} = \min \{7; 12\} = 7$, $r=2$; для вектора A_4 : $\Theta_r = \min \left\{ \frac{14}{2}; \frac{4}{1/3} \right\} = \min \{4,66; 12\} = 4,66$, $r=2$. Добутки для вектора A_1 : $-34 \cdot 7 = -238$; для вектора A_4 : $-48 \cdot 4,66 = -223,7$. Вважаємо номер стовпця, що вводиться в черговий базис, $k = 1$ (тому що $|-238| > |-223,7|$). З базису повинен бути виведеним стовець із номером 2. Отримуємо черговий припустимий базис задачі {1, 3, 5}. Елемент, що перебуває на перетинанні виділених стовпця й рядка таблиці є ведучим, він дорівнює 2. Застосувавши формули (2.12)—(2.14), переходимо до симплекс-таблиці, що відповідає другій ітерації, і вважаємо індекс поточної ітерації $q = 2$.

Базис	$C_{\text{баз}}$	C_j	50	-10	6	40	-30
		B	A_1	A_2	A_3	A_4	A_5
A_1	50	7	1	1/2	0	3/2	0
A_3	6	10,3	0	0,2	1	-0,3	0
A_5	-30	1,7	0	-0,2	0	-0,2	1
L_j		360,8	50	32,2	6	79,2	-30
Δ_j			0	42,2	0	39,2	0

Одержуємо новий план $x^2 = \{7; 0; 10,3; 0; 1,7\}$. Як видно з таблиці, рядок оцінок містить тільки невід'ємні значення, тому досягнутий базис $\{1, 3, 5\}$ є оптимальним. Отже, вектор $x^* = \{7; 0; 10,3; 0; 1,7\}$ є оптимальним планом (точкою максимуму) задачі, максимальне значення цільової функції дорівнює $L^* = L(x^*) = 360,8$.

Збіжність симплекс-методу. Виродженість у задачах ЛП. Найважливішою властивістю будь-якого обчислювального алгоритму є збіжність, тобто можливість одержання в ході його застосування шуканих результатів (із заданою точністю) за кінцеве число кроків (ітерацій).

Легко помітити, що проблеми зі збіжністю симплекс-методу потенційно можуть виникнути на етапі вибору значення r у випадку, коли однакові мінімальні значення відношення $\Theta_r = \min_i \left\{ \frac{b_i}{a_{ij}} \right\}$ будуть досягнуті для кількох рядків

таблиці одночасно. Тоді на наступній ітерації стовпець b^{q+1} -й міститиме нульові елементи. Нагадаємо, що припустимий базисний план канонічної задачі ЛП, що відповідає поточному базису, називають виродженим, якщо деякі його базисні компоненти дорівнюють нулю, тобто вектор b^q містить нульові елементи.

Задачу ЛП, що має вироджені плани, називають виродженою. При виході на вироджений план ми фактично одержуємо розкладання вектора \bar{B} на меншу чим m , кількість векторів \bar{A}_j і, отже, втрачаємо можливість коректно визначити, введення якого стовпця до базису призведе до зростання значення цільової функції. Подібні ситуації, в остаточному підсумку, можуть призвести до зациклення обчислювального процесу, тобто до нескінченного перебору тих самих базисів.

З погляду першої геометричної інтерпретації ЗЛП ситуація виродженості означає, що через деяку кутову точку багатогранної множини припустимих планів задачі, що відповідає поточному базисному плану, проходить більш чим m гіперплощин обмежень задачі. Іншими словами, одне або кілька обмежень у цій точці є надлишковими. Останнє дає повід для міркувань про економічну сторону проблеми виродженості як проблеми наявності надлишкових обмежень і в деяких випадках визначає шляхи її розв'язання.

Ідея методу розв'язання вироджених задач ЛП, що дістала назви **методу збурювань**, полягає в тому, що при виході на вироджений план здійснюють незначний зсув вектора \bar{B} , і виродженість усувається.

Необхідно сказати, що розглянута проблема зациклення для більшості практично значущих задач є досить рідкою й малоймовірною. Більше того, вона дуже часто вирішується за рахунок помилок округлень при виконанні розрахунків на ЕОМ.

Знаходження припустимого базисного плану. У розглянутому вище прикладі вихідний базисний план, необхідний для початку обчислень за симплекс-методом, був підібраний за рахунок особливостей матриці умов. Дійсно, ця матриця вже містила необхідну кількість «майже базисних» стовпців. Оче-

новної задачі. При цьому всі рядки симплекс-таблиці, отриманої на останній ітерації допоміжної задачі, переносять до першої таблиці основної задачі.

У випадку, коли оптимальний план допоміжної задачі все-таки містить не рівні нулю фіктивні компоненти, припустимі плани у вихідній задачі відсутні, тобто $D = \emptyset$.

Контрольні запитання

1. Сформулюйте задачу лінійного програмування.
2. Дайте визначення для наступних понять: план, припустимий план, оптимальний план, розв'язок задачі.
3. Чим відрізняється загальна задача лінійного програмування від канонічної?
4. Чи завжди загальну задачу лінійного програмування можна привести до канонічного виду?
5. Яку точку опуклої множини називають кутовою?
6. В чому полягає перша геометрична інтерпретація задачі лінійного програмування?
7. Який план ЗЛП називають базисним?
8. Як пов'язані базисні плани й кутові точки області визначення задачі лінійного програмування?
9. Який план задачі лінійного програмування називають виродженим?
10. Сформулюйте критерій оптимальності припустимого базисного плану, застосовуваний у симплекс-методі.
11. Сформулюйте основні етапи стандартної ітерації симплекс-методу.
12. Для чого застосовують перетворення Жордана-Гаусса?
13. Який елемент симплекс-таблиці називають ведучим?
14. При яких умовах роблять висновок про необмеженість цільової функції в розв'язуваній задачі?
15. Чи можна заздалегідь точно визначити кількість ітерацій, що буде потрібна для розв'язання задачі симплекс-методом? Чи можна знайти верхню границю для даної величини?
16. Яку задачу називають виродженою? За якими ознаками можна впізнати, що поточний план є виродженим?
17. Поясніть, в чому полягає основна ідея методу збурювань?
18. Для чого призначений метод мінімізації нев'язань?

ТЕМА 3. ТРАНСПОРТНА ЗАДАЧА

3.1. Транспортна задача в матричній постановці та її властивості

Економіко-математична модель задачі. Нехай є m пунктів відправлення (постачальників) A_1, A_2, \dots, A_m , у яких знаходиться однорідна продукція в кількостях a_1, a_2, \dots, a_m відповідно. Нехай є n пунктів призначення (споживачів) B_1, B_2, \dots, B_n , що подали заявки відповідно на b_1, b_2, \dots, b_n одиниць вантажу. Сума всіх заявок дорівнює сумі всіх запасів.

Відомі вартості c_{ij} перевезення одиниці продукції з i -го пункту відправлення в j -й пункт призначення. Вважається, що вартість перевезення кількох одиниць вантажу пропорційна їх числу.

Потрібно скласти такий план перевезень (звідки, куди й скільки одиниць везти), щоб всі заявки були виконані, а загальна вартість всіх перевезень була мінімальною.

Поставимо цю задачу як задачу лінійного програмування. Позначимо x_{ij} — кількість одиниць вантажу, що відправляється з i -го ПВ A до j -го ПП B .

Сукупність чисел x_{ij} називатимемо «планом перевезень», а самі величини x_{ij} — «перевезеннями». Ці невід'ємні змінні повинні задовольняти наступним умовам:

1. Сумарна кількість вантажу, що направляється з кожного ПВ до усіх ПП, повинна дорівнювати запасу вантажу в даному пункті.
2. Сумарна кількість вантажу, що доставляється до кожного ПП із усіх ПВ, повинна дорівнювати заявці, поданої даним пунктом.
3. Сумарна вартість всіх перевезень, тобто сума величин x_{ij} , помножених на відповідні вартості c_{ij} , повинна бути мінімальною.

Отже, задача зводиться до визначення такого плану перевезень певного продукту з пунктів його виробництва до пунктів споживання $x = (x_{11}, \dots, x_{1n}, x_{21}, \dots, x_{2n}, \dots, x_{i1}, \dots, x_{in}, \dots, x_{m1}, \dots, x_{mn})$, який мінімізує цільову функцію

$$f(x) = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n c_{ij} x_{ij} \quad (3.1)$$

на множині припустимих планів

$$\sum_{j=1}^n x_{ij} = a_i; \quad \sum_{i=1}^m x_{ij} = b_j; \quad x_{ij} \geq 0; \quad i = \overline{1, m}; \quad j = \overline{1, n} \quad (3.2)$$

при дотриманні умови балансу

$$\sum_{i=1}^m a_i = \sum_{j=1}^n b_j \quad (3.3)$$

Якщо умова (3.3) виконується, то задачу називають *збалансованою* або *закритою*, а інакше задачу називають *незбалансованою* або *відкритою*.

Транспортна задача є представником класу задач лінійного програмування й тому має всі якості лінійних оптимізаційних задач, але одночасно вона має й ряд додаткових корисних властивостей, які дозволили розробити спеціальні методи для її розв'язання.

Число лінійно незалежних серед рівнянь в умовах-обмеженнях транспортної задачі (ТЗ) дорівнює

$$m + n - 1,$$

отже число базисних змінних також дорівнює

$$m + n - 1.$$

Загальне число змінних x_{ij} у транспортній задачі дорівнює $m * n$, а число вільних змінних

$$k = mn - (m + n - 1) = (m - 1)(n - 1).$$

Відомо, що в задачі лінійного програмування оптимальний розв'язок досягається в одній з вершин ОДР, в опорній точці, де принаймні k змінних дорівнюють нулю. Виходить, у нашому випадку для оптимального плану принаймні $(m-1)(n-1)$ перевезень повинні дорівнювати нулю (з відповідних ПВ у відповідні ПП нічого не перевозиться).

Називатимемо будь-який план перевезень *припустимим*, якщо він задовольняє умовам-обмеженням (всі заявки задоволені, всі запаси вичерпані).

Припустимий план будемо називати *опорним*, якщо в ньому відмінні від нуля не більш за $m + n - 1$ базисних перевезень, а інші $(m-1)(n-1)$ перевезень дорівнюють нулю.

План називатимемо *оптимальним*, якщо він, серед всіх припустимих планів, призводить до мінімальної сумарної вартості перевезень ($L = \min$).

В силу особливої структури ТЗ при її розв'язанні не приходить довго розв'язувати систему рівнянь. Всі операції із знаходження оптимального плану зводяться до маніпуляцій безпосередньо з таблицею, де в певному порядку записані умови транспортної задачі: перелік ПВ й ПП, заявки й запаси, а також вартості перевезень c_{ij} . У міру заповнення цієї таблиці в її клітках проставляють самі перевезення x_{ij} . Транспортна таблиця складається з m рядків і n стовпців. Рядки транспортної таблиці відповідають пунктам виробництва (в останній клітці кожного рядка зазначений обсяг запасу продукту a_i), а стовпці — пунктам споживання (остання клітка кожного стовпця містить значення заявки b_j). У правому верхньому куті кожної клітки ставлять вартість c_{ij} перевезення одиниці продукту з A_i до B_j , а центр клітки залишають вільним, щоб поміщати до нього саме перевезення x_{ij} . Клітки, які містять нульові перевезення ($x_{ij}=0$), називають вільними, а ненульові — зайнятими ($x_{ij}>0$).

3.2. Методи побудови опорного плану

За аналогією з іншими задачами лінійного програмування розв'язання транспортної задачі починається з побудови припустимого базисного плану. Найпростіший спосіб його знаходження ґрунтується на так званому **методі північно-західного кута**. Суть методу полягає в послідовному розподілі всіх запасів, наявних у першому, другому і т.д. пунктах виробництва, до першого,

другого і т.д. пунктів споживання. Кожний крок розподілу зводиться до спроби повного вичерпання запасів у черговому пункті виробництва або до спроби повного задоволення потреб у черговому пункті споживання. На кожному кроці q величини поточних нерозподілених запасів позначають a_i^q , а поточних незадоволених потреб — b_j^q . Побудову припустимого початкового плану, відповідно до методу північно-західного кута, починають з лівого верхнього кута транспортної таблиці. Для чергової клітки, розташованої в рядку i і стовпці j , розглядають значення нерозподіленого запасу в i -ому пункті виробництва й незадоволеної заявки в j -ому пункті споживання, з них вибирають мінімальне й призначають як обсяг перевезення між даними пунктами: $x_{ij} = \min\{a_i^q, b_j^q\}$. В результаті цього значення нерозподіленого запасу й незадоволеної потреби у відповідних пунктах зменшуються:

$$a_i^{(q+1)} = a_i^q - x_{ij}; \quad b_j^{(q+1)} = b_j^q - x_{ij}.$$

Очевидно, що на кожному кроці виконується хоча б одна з рівностей: $a_i^{(q+1)} = 0$ або $b_j^{(q+1)} = 0$. Якщо справедливо $a_i^{(q+1)} = 0$, це означає, що весь запас i -го пункту виробництва вичерпаний і необхідно перейти до розподілу запасу в пункті виробництва $i + 1$, тобто переміститися до наступної клітки униз за стовпцем. Якщо $b_j^{(q+1)} = 0$, то повністю задоволена заявка для j -го пункту, після чого виконують перехід на клітку, розташовану праворуч за рядком. Знову обрана клітка стає поточною, і для неї повторюють всі перелічені операції.

Грунтуючись на умові балансу запасів і заявок (3.3), неважко довести, що за кінцеве число кроків буде отриманий припустимий план. У силу тієї самої умови число кроків алгоритму не може бути більшим за $m+n-1$, тому завжди залишаться вільними (нульовими) $mn-(m+n-1)$ кліток. Отже, отриманий план є базисним. Не виключено, що на певному проміжному кроці поточний нерозподілений запас опиниться рівним поточній незадоволеній заявці ($a_i^q = b_j^q$). У цьому випадку перехід до наступної клітки відбувається в діагональному напрямку (одночасно змінюються поточні пункти виробництва й призначення), а це означає «втрату» одного ненульового компонента в плані або, виродженість побудованого плану.

Розглянемо приклад. З 3-х пунктів виробництва необхідно вивезти один і той самий продукт в 5 пунктів споживання. Транспортні витрати, обсяг виробництва й споживання наведені в табл. 3.1.

Таблиця 3.1 – Вихідні дані

	В₁	В₂	В₃	В₄	В₅	Запаси
А₁	7	5	2	8	7	125
А₂	8	9	4	6	9	60
А₃	5	1	9	2	3	115
Заявки	30	50	100	40	80	300

Зауважимо, що запаси дорівнюють заявкам. Отже, задача є збалансованою.

Визначимо кількість базисних змінних

$$m + n - 1 = 3 + 5 - 1 = 7.$$

Кількість вільних змінних

$$(n-1)*(m-1) = (5-1)*(3-1) = 8.$$

Іншими методами визначення початкового опорного плану є метод мінімальної вартості, метод подвійної переваги або метод апроксимації Фогеля.

У табл. 3.2 показаний процес пошуку припустимого плану за **методом північно-західного кута**, включаючи послідовну зміну обсягу нерозподілених запасів і незадоволених потреб. Стрілки відображають траєкторію переходу по клітках транспортної таблиці, а цифри, що знаходяться за її межами, - поточні нерозподілені залишки після призначення обсягу для чергової клітки.

Таблиця 3.2 – Визначення опорного плану методом північно-західного кута

	B ₁	B ₂	B ₃	B ₄	B ₅	Запаси			
A ₁	30 ⇒	50 ⇒	45 ↓			125	95	45	0
A ₂			55 ⇒	5 ↓		60		5	0
A ₃				35 ⇒	80	115		80	0
Заявки	30	50	100	40	80	300			
	0	0	55						
			0	35					
				0	0				

Знайдений опорний план $x = (30, 50, 45, 0, 0, \dots)$. Значення цільової функції при цьому плані перевезень

$$L = 30*7+50*5+45*2+55*4+5*6+35*2+80*3 = 1110.$$

Особливістю припустимого плану, побудованого за методом північно-західного кута, є те, що цільова функція на ньому приймає значення, як правило, далеке від оптимального. Це відбувається тому, що при його побудові ніяк не враховуються значення c_{ij} . У зв'язку із цим на практиці для одержання вихідного плану використовують інший спосіб - метод мінімального елемента, у якому при розподілі обсягів перевезень у першу чергу займають клітки з найменшими цінами.

Метод мінімальної вартості полягає в тому, що в таблиці вартостей вибирають найменшу, і в цій клітці записують найменше із чисел (a_i, b_j) , табл. 3.3.

Таблиця 3.3 – Визначення опорного плану за методом мінімальної вартості

	B ₁	B ₂	B ₃	B ₄	B ₅	Запаси
A ₁	7 25	5	2 100	8	7	125
A ₂	8 5	9	4	6	9 55	60
A ₃	5	1 50	9	2 40	3 25	115
Потреби	30	50	100	40	80	300

Значення цільової функції при цьому плані перевезень

$$L = 25*7+100*2+5*8+55*9+50*1+40*2+25*3 = 1115.$$

Метод подвійної переваги показаний у табл. 3.4. Він полягає в тому, що в кожному стовпці позначають знаком V клітку з найменшою вартістю, потім те саме роблять у кожному рядку. У клітки з W заносять найбільші обсяги перевезень. Потім розподіляють перевезення по клітках, позначеним V. У частині таблиці, що залишилася, перевезення розподіляють за методом найменшої вартості.

Таблиця 3.4 – Визначення опорного плану за методом подвійної переваги

	B ₁	B ₂	B ₃	B ₄	B ₅	Запаси
A ₁	⁷ 25	⁵	² 100 W	⁸	⁷	125
A ₂	⁸ 5	⁹	⁴ V	⁶	⁹ 55	60
A ₃	⁵ V	¹ 50 W	⁹	² 40 V	³ 25 V	115
Заявки	30	50	100	40	80	300

Отриманий опорний план збігається із планом за методом мінімальної вартості, $L = 1115$.

Приймати як опорний треба той план, для якого транспортні витрати опинилися найменшими. Отже, за опорний треба прийняти план, отриманий за методом північно-західного кута.

Цей план є **припустимим**, тому що суми за рядками дорівнюють запасам, а суми за стовпцями дорівнюють заявкам.

Отриманий план є **опорним**, тому що число ненульових перевезень дорівнює $m + n - 1 = 3 + 5 - 1 = 7$, а число нульових перевезень дорівнює $(n-1)*(m-1) = (5-1)*(3-1) = 8$.

План можна покращити (табл. 3.2), якщо зменшити перевезення в дорогій клітці, наприклад (1.1), і збільшити в дешевій (3.1).

Щоб при цьому план залишався опорним, необхідно одну з вільних кліток зробити базисною, а одну з базисних – вільною.

3.3. Метод потенціалів

Одним з методів розв'язання транспортної задачі є метод, що одержав назву **методу потенціалів**. Вперше він був запропонований в 1949 р. Л. В. Канторовичем і М. К. Гавуріним. Пізніше на базі загальних ідей лінійного програмування аналогічний метод був запропонований Дж. Данцигом.

Так само як транспортна задача є окремим випадком задачі ЛП, так і метод потенціалів, загалом кажучи, може трактуватися як різновид симплексних процедур. Він являє собою ітеративний процес, на кожному кроці якого розглядають деякий поточний базисний план, перевіряють його оптимальність, і при необхідності здійснюють, перехід до «кращого» базисного плану.

Алгоритм методу потенціалів починається з вибору деякого припустимого базисного плану. Якщо початковий опорний план має $m+n-1$ додатних пере-

везень, то його називають **невиродженим**. Якщо опорний план має менше за $m+n-1$ додатних перевезень, то його називають **виродженим**.

У цьому початковому опорному плані кожному пункту ставлять у відповідність деяке число, назване його **попереднім потенціалом**. Якщо даний план **невироджений** (число ненульових базисних кліток дорівнює $m+n-1$) то за ним можна так визначити потенціали u_i і v_j , щоб для кожної базисної клітки (тобто для тієї, в якій $x_{ij} > 0$) виконувалася умова

$$v_j - u_i = c_{ij}, \quad \text{якщо } x_{ij} > 0. \quad (3.4)$$

Теорема 3.1. Якщо план ТЗ є оптимальним, то йому відповідає система з $m+n$ чисел, що задовольняють умовам:

$$\begin{aligned} u_i + v_j &= c_{ij} & \text{для } x_{ij} > 0, \\ u_i + v_j &\leq c_{ij} & \text{для } x_{ij} = 0, \quad i = \overline{1, m}; \quad j = \overline{1, n}. \end{aligned}$$

де u_i і v_j - потенціали постачальників і споживачів відповідно.

Отже, якщо хоча б для однієї вільної клітки

$$\Delta_{ij} = u_i + v_j - c_{ij} > 0, \quad (3.5)$$

то план не оптимальний і вимагає поліпшення.

Оскільки система (3.4) містить $m+n-1$ рівнянь й $m+n$ невідомих, то один з потенціалів можна задати довільно (наприклад, дорівняти v_i або u_i , до нуля). Після цього інші невідомі u_i і v_j визначаються однозначно.

Розглянемо процес визначення потенціалів поточного плану транспортної задачі на прикладі. У табл. 3.3 переписані умови задачі з табл. 3.1 і її припустимий базисний план, побудований за методом північно-західного кута з табл. 3.2.

Потенціал першого пункту виробництва приймаємо рівним нулю ($u_1=0$). Тепер, знаючи його, можна визначити потенціали для всіх пунктів споживання, пов'язаних з першим пунктом виробництва ненульовими перевезеннями. У цьому випадку їх три (це перший, другий і третій пункти), отримаємо:

$$v_1 = c_{11} - u_1 = 7 - 0 = 7; \quad v_2 = c_{12} - u_1 = 5 - 0 = 5; \quad v_3 = c_{13} - u_1 = 2 - 0 = 2.$$

Маючи v_3 і з огляду на те, що в другому рядку таблиці існують ненульові компоненти x_{23} і x_{24} , можна визначити $u_2 = c_{23} - v_3 = 4 - 2 = 2$, $v_4 = c_{24} - u_2 = 6 - 2 = 4$, після чого з'являється можливість розрахувати $u_3 = c_{34} - v_4 = 2 - 4 = -2$ і, нарешті, $v_5 = c_{35} - u_3 = 3 - (-2) = 5$. В результаті отримали повну систему потенціалів, показану в табл. 3.5.

Таблиця 3.5 – Визначення потенціалів для початкового опорного плану

		$v_1=7$	$v_2=5$	$v_3=2$	$v_4=4$	$v_5=5$	
		B₁	B₂	B₃	B₄	B₅	Запаси
$u_1=0$	A₁	7 30	5 50	2 45	8	7	125
$u_2=2$	A₂	8	9	4 55	6 5	9	60
$u_3=-2$	A₃	5	1	9	2 35	3 80	115
	Заявки	30	50	100	40	80	300

Для вільних кліток транспортної таблиці обчислюють величини $\Delta_{ij}=v_j+u_i- c_{ij}$. У табл. 3.6 вони вписані для всіх небазисних кліток під цінами.

Таблиця 3.6 – Перевірка оптимальності поточного плану (обчислення оцінок Δ_{ij})

		$v_1=7$	$v_2=5$	$v_3=2$	$v_4=4$	$v_5=5$	
		B₁	B₂	B₃	B₄	B₅	Запаси
$u_1=0$	A₁	7 30	5 50	2 45	8 0	7 -2	125
$u_2=2$	A₂	8 1	9 -2	4 55	6 5	9 -2	60
$u_3=-2$	A₃	5 0	1 2	9 -9	2 35	3 80	115
Заявки		30	50	100	40	80	300

Відповідно до теореми 3.1, якщо всі $\Delta_{ij} \leq 0$, план є оптимальним, у протилежному випадку, якщо існує хоча б одна клітка, для якої $\Delta_{ij} > 0$, його можна поліпшити. Процес «поліпшення» плану полягає у визначенні клітки, що вводиться, й клітки, що виводиться. У цьому простежується змістовна аналогія методу з відповідними пунктами симплекс-процедур.

Кандидатом на введення може бути будь-яка клітка, у якій $\Delta_{ij} > 0$, оскільки після введення її до базису буде забезпечена рівність $v_j + u_i = c_{ij}$. Для визначеності рекомендується брати ту клітку, у якій оцінка Δ_{ij} максимальна. У розглянутому нами прикладі це буде клітка (3, 2).

Виведена клітка визначається за допомогою так званого ланцюжка перетворення плану, що описує характер перерозподілу вантажних потоків. У відповідності із властивостями транспортної задачі для невиродженого базисного плану в поточній таблиці можна утворити замкнутий ланцюжок, що складається з вертикальних і горизонтальних ланок, однією з вершин якого є обрана вільна клітка, а інші - зайняті клітки. У табл. 3.7 показаний ланцюжок перетворення поточного плану щодо клітки, яка вводиться до нього, (3, 2).

Таблиця 3.7 – Перетворення поточного плану

		$v_1=7$	$v_2=5$	$v_3=2$	$v_4=4$	$v_5=5$	
		B₁	B₂	B₃	B₄	B₅	Запаси
$u_1=0$	A₁	7 30	5 50	2 45	8 4	7 5	125
$u_2=2$	A₂	8 5	9 3	4 55	6 5	9 3	60
$u_3=-2$	A₃	5 9	1 +Θ 7	9 4	2 35	3 80	115
Заявки		30	50	100	40	80	300

Логіка алгоритму побудови ланцюжка досить проста: «вийшовши» із клітки (3, 2) у горизонтальному напрямку, ми повинні «зупинитися» у тій зайнятій клітці плану, з якої зможемо рухатися далі за вертикаллю. У даному прикладі цій вимозі задовольняють як клітка (3, 4), так і клітка (3, 5). Однак ланцюжок від (3, 5) не може бути продовжений далі, у той час як рухаючись від (3, 4) за

вертикаллю до (2, 4) і далі до (2,3), ми вертаємося через клітки (1, 3) і (1, 2) до вихідної клітки (3, 2) і утворюємо замкнений цикл.

У побудованому ланцюжку, починаючи із клітки, що вводиться (яка вважається першою), позначаються вершини: непарні — «+ Θ », а парні «- Θ ». Знаком «+» позначають ті клітки, у яких обсяги перевезень повинні збільшитися (такою, зокрема, є клітка, що вводиться до плану, оскільки вона повинна стати базисною). Знаком «-» — ті клітки, у яких перевезення зменшуються з метою збереження балансу. Серед множини кліток, позначених знаком «-», обирають клітку з найменшим значенням x_{ij} . Вона й стає кандидатом на вивід, тому що зменшення обсягу перевезень на більшу величину може призвести до від'ємних значень x_{ij} в інших «мінусових» клітках. Потім провадиться перерахування плану за ланцюжком: до обсягів перевезень у клітках, позначених знаком «+», додається обсяг Θ , а з обсягів кліток, позначених знаком «-», він віднімається. У результаті вводу однієї клітки й виводу іншої утворюється новий базисний план, для якого на наступній ітерації описані вище дії повторюються.

У нашому прикладі знаком «-» позначені клітки (3, 4), (2, 3) і (1, 2), причому $x_{34}=35$, $x_{23}=55$, $x_{12}=50$. Обчисливши значення $\Theta = \min\{x_{34}, x_{23}, x_{12}\} = 35$, здійснюємо перетворення й переходимо до наступного базисного плану, показаному в табл. 3.8.

Таблиця 3.8 – Оцінка оптимальності наступного базисного плану

		$v_1=7$	$v_2=5$	$v_3=2$	$v_4=4$	$v_5=7$	
		B₁	B₂	B₃	B₄	B₅	Запаси
$u_1=0$	A₁	7 30	5 15	2 80	8 -4	7 0	125
$u_2=2$	A₂	8 1	9 -2	4 20	6 40	9 0	60
$u_3=-4$	A₃	5 -2	1 35	9 -11	2 -2	3 80	115
Заявки		30	50	100	40	80	300

Для знов отриманого плану повторюють дії стандартної ітерації: розраховують потенціали й оцінки для небазисних кліток транспортної таблиці. Як можна бачити, план у табл. 3.6 також не є оптимальним (у клітці (2, 1) $\Delta_{21}=1>0$), тому знову будуємо ланцюжок перетворення плану й переходимо до наступного базисного плану за ланцюжком в табл. 3.9.

Таблиця 3.9 – Перетворення поточного базисного плану

		$v_1=7$	$v_2=5$	$v_3=2$	$v_4=4$	$v_5=7$	
		B₁	B₂	B₃	B₄	B₅	Запаси
$u_1=0$	A₁	7 30 - Θ	5 15	2 80 + Θ	8 -4	7 0	125
$u_2=2$	A₂	8 + Θ 1	9 -2	4 20 - Θ	6 40	9 0	60
$u_3=-4$	A₃	5 -2	1 35	9 -11	2 -2	3 80	115
Заявки		30	50	100	40	80	300

Визначивши $\Theta=20$, одержимо

Таблиця 3.10 – Оптимальний базисний план

		$v_1=7$	$v_2=5$	$v_3=2$	$v_4=5$	$v_5=7$	
		B₁	B₂	B₃	B₄	B₅	Запаси
$u_1=0$	A₁	7 10	5 15	2 100	8 -3	7 0	125
$u_2=1$	A₂	8 20	9 -3	4 -1	6 40	9 -1	60
$u_3=-4$	A₃	5 -2	1 35	9 -11	2 -1	3 80	115
	Заявки	30	50	100	40	80	300

З транспортної табл. 3.10 видно, що отриманий план оптимальний, тому що всі оцінки для небазисних кліток $\Delta_{ij} \leq 0$, тобто $u_i + v_j$ не перевищують відповідних цін c_{ij} . За цим планом обчислюють оптимальне (найменше) значення сумарних витрат на перевезення

$$L^* = 10x_7 + 15x_5 + 100x_2 + 20x_8 + 40x_6 + 35x_1 + 80x_3 = 1020.$$

3.4. Випадок виродження

Зупинимося на ситуації виникнення виродженого плану. Якщо задача вироджена, то на якомусь етапі розв'язання може виявитися, що таблиця містить менше за $m+n-1$ заповнених кліток. Це, зокрема, може відбутися, якщо однако-ве мінімальне значення буде досягнуто відразу на кількох клітках, позначених знаком «-». Для подолання виродженості в транспортній задачі поточний план доповнюють необхідною кількістю нульових кліток (фіктивними перевезеннями) так, щоб вони дозволяли розрахувати повну систему потенціалів, і далі діяти відповідно до правил описаного вище алгоритму. Тобто, якщо не вистачає k заповнених кліток, то їх вважають фіктивно заповненими. Фактично такий прийом є аналогом методу збурювань для транспортної задачі як окремого випадку ЗЛП. До такого висновку легко прийти, якщо покласти, що фіктивні клітки, що додаються, містять певний малий обсяг ε .

Розглянемо приклад. З трьох кар'єрів до чотирьох склозаводів возять глину. Вартості перевезень, потужності кар'єрів і потреби заводів наведені в табл. 3.11.

Таблиця 3.11 – Вихідні дані

	B₁	B₂	B₃	B₄	Запаси
A₁	3	9	7	4	50
A₂	6	8	10	6	65
A₃	5	4	7	6	50
Потреби	50	20	65	30	165

Опорний план визначимо за методом найменшої вартості.

Таблиця 3.12 – Початковий опорний план

		$v_1=3$	$v_2=5$	$v_3=8$	$v_4=4$	
		B₁	B₂	B₃	B₄	Запаси
$u_1=0$	A₁	3 50	9 -4	$+\Theta$ 7 1	$-\Theta$ 4 [0]	50
$u_2=2$	A₂	6 -1	8 -1	$-\Theta$ 10 35	$+\Theta$ 6 30	65
$u_3=-1$	A₃	5 -3	4 20	7 30	6 -3	50
	Потреби	50	20	65	30	165

У табл. 3.12 заповнених кліток 5, а необхідно $m+n-1 = 3+4-1 = 6$. Потрібна одна фіктивно заповнена клітка. Вважатимемо клітку (1, 4) заповненою. Перевіримо план на оптимальність.

План не оптимальний, тому що $\Delta_{13} = 1$. $\Theta = \min(35, 0) = 0$. План залишається таким самим, але фіктивно заповненою буде клітка (1, 3). Перевіримо його на оптимальність.

Таблиця 3.13 – Перевірка базисного плану на оптимальність

		$v_1=3$	$v_2=4$	$v_3=7$	$v_4=3$	
		B₁	B₂	B₃	B₄	Запаси
$u_1=0$	A₁	3 50	9 -5	7 0	4 -1	50
$u_2=3$	A₂	6 0	8 -1	10 35	6 30	65
$u_3=0$	A₃	5 -2	4 20	7 30	6 -3	50
	Потреби	50	20	65	30	165

Всі $\Delta_{ij} \leq 0$, отже план є оптимальним. Вартість перевезень при такому плані становить $L = 50 \cdot 3 + 20 \cdot 4 + 0 \cdot 7 + 35 \cdot 10 + 30 \cdot 7 + 30 \cdot 6 = 970$.

3.5. Транспортна задача за критерієм часу

Транспортну задачу, крім використання її з метою мінімізації витрат при транспортуванні вантажів, застосовують для оптимізації цілого ряду економічних процесів.

Природним застосуванням транспортної задачі є **задача мінімізації часу транспортування**. Наприклад, на підприємстві є задана кількість виробничих ліній, що працюють із заданою продуктивністю. Є також задана кількість складів продукції. Відомий час транспортування від кожної лінії до кожного складу. Задача зводиться до вибору таких маршрутів, при використанні яких час, затрачений на транспортування, буде мінімальним.

Іншою задачею є вибір оптимального варіанта з використання наявного устаткування. Задача полягає у виборі оптимального плану виробництва виробів при мінімізації часу, необхідного на їх виготовлення. Цю задачу формулюють в такий спосіб. Є задана кількість видів устаткування, на кожному з яких виготовляють певну задану кількість виробів. Відома продуктивність для кожного типу устаткування й кожного виробу. Необхідно скласти план, при якому підприємство затратить мінімальну кількість часу на виготовлення всіх виробів.

Розглянемо приклад. Визначити мінімальний час виготовлення трьох видів виробів на трьох типах устаткування. Продуктивність устаткування (a_i) і план виробництва виробів (b_j) наведені в табл. 3.14.

Таблиця 3.14 – Вихідні дані

	B₁	B₂	B₃	План
A₁	15	7	8	240
A₂	9	4	11	80
A₃	6	3	7	180
Продуктивність	200	160	140	500

Задача є збалансованою. Знайдемо початковий базисний план за методом мінімальної вартості. Найменша продуктивність, що дорівнює 3, записана в клітці (3, 2). Потужність устаткування третього типу дорівнює 180, а необхідна кількість виробів другого типу дорівнює 160, тобто $\min\{180, 160\}=160$. Тому в клітку (3, 2) вписуємо число 160. Другий стовпець випадає з подальшого розгляду, оскільки продуктивність устаткування другого типу вичерпана. Аналогічно заповнюємо інші клітки табл. 3.15.

Таблиця 3.15 – Визначення початкового опорного плану

		$v_1=15$	$v_2=12$	$v_3=8$	
		B₁	B₂	B₃	План
$u_1=0$	A₁	15 -Θ 100	7 +Θ 5	8 140	240
$u_2=-6$	A₂	9 80	4 2	11 -9	80
$u_3=-9$	A₃	6 +Θ 20	3 -Θ 160	7 -8	180
	Продуктивність	200	160	140	500

Відповідно до отриманого плану час виготовлення всіх виробів становить $L = 100 \cdot 15 + 140 \cdot 8 + 80 \cdot 9 + 20 \cdot 6 + 160 \cdot 3 = 3940$. Визначимо потенціали u_i і v_j для зайнятих кліток: $u_1=0$; $v_1=15$; $v_3=8$; $u_2=9-15=-6$; $u_3=6-15=-9$; $v_2=3-(-9)=12$. Обчислимо оцінки для вільних кліток: $\Delta_{12}=(12+0)-7=5$; $\Delta_{22}=(12-6)-4=2$; $\Delta_{23}=(-6+8)-11=-9$; $\Delta_{33}=(-9+8)-7=-8$.

Оскільки оцінки вільних кліток (1, 2) і (2, 2) додатні, план не оптимальний. Перейдемо до нового базисного плану, побудувавши цикл для клітки (1, 2), $\Theta = \min\{100, 160\}=100$. Новий базисний план наведений у табл. 3.16. Із клітки (1,1) вироби в кількості 100 од. переносимо до клітки (1,2). Із клітки (3,2) вироби в кількості 100 од. переносимо до клітки (3,1).

Таблиця 3.16 – Визначення наступного базисного плану

		$v_1=10$	$v_2=7$	$v_3=8$	
		B₁	B₂	B₃	План
$u_1=0$	A₁	15 -5	7 100	8 140	240
$u_2=-1$	A₂	$-\Theta$ 9 80	$-\Theta$ 4 2	11 -4	80
$u_3=-4$	A₃	$+\Theta$ 6 120	$-\Theta$ 3 60	7 -3	180
	Продуктивність	200	160	140	500

Відповідно до отриманого плану час виготовлення всіх виробів складе $L=100*7+140*8+80*9+120*6+60*3 = 3440$. Перевірка плану на оптимальність показує, що він не оптимальний, тому що в клітці (2,2) Δ_{22} додатна. Побудуємо цикл для цієї клітки й перетворимо план при $\Theta=60$. Новий базисний план наведений у табл. 3.17.

Таблиця 3.17 – Визначення наступного базисного плану

		$v_1=12$	$v_2=7$	$v_3=8$	
		B₁	B₂	B₃	План
$u_1=0$	A₁	15 -3	7 100	8 140	240
$u_2=-3$	A₂	9 20	4 60	11 -6	80
$u_3=-6$	A₃	6 180	3 -2	7 -5	180
	Продуктивність	200	160	140	500

Перевірка показує оптимальність плану. Відповідно до отриманого плану час виготовлення всіх виробів складе $L = 100*7+140*8+20*9+60*4+180*6 = 3320$, і він є мінімальним.

Контрольні запитання

1. Які специфічні властивості дозволяють виділити транспортні задачі в окремий клас з множини задач лінійного програмування?
2. Опишіть методи побудови припустимого плану транспортної задачі.
3. Скільки ненульових елементів повинен містити не вироджений базисний план транспортної задачі?
4. Сформулюйте критерій оптимальності для припустимого плану транспортної задачі.
5. Поясніть, на чому заснований метод потенціалів?
6. З чого впливає критерій оптимальності припустимого плану транспортної задачі?
7. Перелічіть основні етапи методу потенціалів.
8. Які умови повинні бути дотримані при побудові ланцюжка перетворення плану в методі потенціалів?
9. Що треба робити при виникненні ситуації виродженості поточного плану в транспортній задачі?

ЗМ 2. Економічна інтерпретація й аналіз оптимальних планів лінійних економіко-математичних моделей

TEMA 4.

ТЕОРІЯ ПОДВІЙНОСТІ ТА ДВОЇСТІ ОЦІНКИ В АНАЛІЗІ РОЗВ'ЯЗКІВ ЛІНІЙНИХ ОПТИМІЗАЦІЙНИХ МОДЕЛЕЙ

4.1. Пряма та двоїста задачі як пара сполучених задач ЛП

Більшість задач лінійного програмування можна розглядати як економічні задачі про розподіл ресурсів b_1, b_2, \dots, b_m між різними споживачами, зокрема, між технологічними процесами $\bar{A}_1, \bar{A}_2, \dots, \bar{A}_n$.

Будь-який припустимий розв'язок задачі лінійного програмування x_1, x_2, \dots, x_n дає конкретний розподіл ресурсів, що вказує частку кожного з них, яка буде витрачена при реалізації певного технологічного процесу.

Загальну задачу лінійного програмування формують в такий спосіб:
знайти

$$L = c_1 x_1 + c_2 x_2 + \dots + c_n x_n \rightarrow \max, \quad (4.1)$$

де x задовольняє обмеженням

[illegible]

Тут a_{ij} – витрати i -го ресурсу на j -й технологічний процес. Зміст обмежень – сумарні витрати i -го ресурсу повинні не перевищувати кількість цього ресурсу, наявного в розпорядженні b_i .

Для будь-якого технологічного процесу актуальним є запитання про те, щоб витрати ресурсів були мінімальними. Позначимо u_i ціну одиниці i -го ресурсу. Тоді можна записати вимогу, щоб вартість ресурсів була мінімальною

$$L' = b_1 u_1 + b_2 u_2 + \dots + b_m u_m \rightarrow \min,$$

а величина витрат на кожний вид технологічного процесу не повинна бути меншою за його вартість

$$\begin{array}{rcl} & a_{11} u_1 + a_{12} u_2 + \dots + a_{1m} u_m & \geq c_1 \\ & a_{12} u_1 + a_{22} u_2 + \dots + a_{m2} u_m & \geq c_2 \\ & & \\ & a_{1n} u_1 + a_{2n} u_2 + \dots + a_{mn} u_m & \geq c_n \\ & u_i & \geq 0 \end{array}$$

Отже, одержали задачу:

знайти такий розв'язок u^* , що перетворює на мінімум цільову функцію

$$L' = \sum_{i=1}^m b_i u_i \rightarrow \min \quad (4.3)$$

і задовольняє обмеженням

[illegible]

Цю задачу називають *двоїстою* щодо вихідної задачі, яку називають *прямою* задачею.

Порівняємо умови прямої й двоїстої задач у матричній формі:

<p>Пряма</p> <p>Знайти таке \bar{X}^*, що</p> $\bar{C}^T \bar{X}^* \rightarrow \max$ <p>при обмеженнях</p> $\bar{A} \bar{X} \leq \bar{B}, \quad \bar{X} \geq 0$	<p>Двоїста</p> <p>Знайти таке \bar{U}^*, що</p> $\bar{B}^T \bar{U}^* \rightarrow \min$ <p>при обмеженнях</p> $\bar{A}^T \bar{U} \geq \bar{C}, \quad \bar{U} \geq 0$
--	--

Загальна схема побудови двоїстої задачі. Якщо задано загальну задачу ЛП, де множина припустимих планів D визначається системою рівнянь і нерівностей (4.2), то двоїстою щодо неї називають загальну задачу ЛП, де D' визначається системою рівнянь і нерівностей (4.4).

При переході від прямої задачі ЛП до двоїстої:

- тип оптимуму змінюється на протилежний, тобто якщо пряма задача є задачею максимізації, то двоїста буде задачею мінімізації й навпаки;
- вектор коефіцієнтів цільової функції \bar{C} й стовпець обмежень \bar{B} міняють-
ся місцями. Тобто коефіцієнти цільової функції прямої задачі c_1, c_2, \dots, c_n стають
вільними членами обмежень двоїстої задачі, а вільні члени обмежень прямої зада-
чі b_1, b_2, \dots, b_m стають коефіцієнтами цільової функції двоїстої задачі;
- матрицю обмежень двоїстої задачі одержують транспонуванням матриці
обмежень прямої задачі \bar{A} ;
- множину індексів змінних, на які накладено умову невід'ємності в пря-
мій задачі (наприклад, $x_j \geq 0$ або $u_i \geq 0$), визначають номери обмежень, що ма-
ють форму нерівностей у двоїстій задачі ($a_j u \geq c_j$ або $a_i x \leq b_i$);
- множину номерів обмежень, що мають форму нерівностей у прямій за-
дачі (наприклад, $a_i x \leq b_i$ або $a_j u \geq c_j$), визначає множина індексів змінних, на
які накладено умову невід'ємності, у двоїстій задачі ($u_i \geq 0$ або $x_j \geq 0$).

З наведених властивостей пари задач впливає важлива властивість — **симетричність відносини подвійності**, тобто задача, двоїста щодо двоїстої, збігається з прямою (вихідною) задачею.

Тим самим можна говорити про пару взаємно двоїстих задач.

4.2. Основні теореми подвійності, їх економічний зміст

Фундаментальні властивості двоїстих задач лінійного програмування формують у вигляді стверджень, що приводяться нижче. Їх зазвичай називають **теоремами подвійності**.

Теорема 4.1. (перша теорема подвійності). Якщо \bar{X}_0 й \bar{U}_0 — припустимі плани для пари двоїстих задач, тобто якщо

$$\bar{A} \bar{X}_0 \leq \bar{B} \quad \text{і} \quad \bar{A}^T \bar{U}_0 \geq \bar{C},$$

то

$$\bar{C}^T \bar{X}_0 \leq \bar{B}^T \bar{U}_0,$$

тобто значення цільової функції прямої задачі ніколи не перевищують значень цільової функції двоїстої задачі.

Доказ:

Оскільки \bar{U}_0 - припустимий план, то

$$\bar{A}^T \bar{U}_0 \geq \bar{C}; \quad (4.5)$$

оскільки \bar{X}_0 - припустимий план, то

$$\bar{A} \bar{X}_0 \leq \bar{B}. \quad (4.6)$$

Помножимо (4.5) на \bar{X}_0^T

$$\bar{X}_0^T \bar{A}^T \bar{U}_0 \geq \bar{X}_0^T \bar{C}; \quad (4.7)$$

помножимо (4.6) на \bar{U}_0^T

$$\bar{X}_0 \bar{A} \bar{U}_0^T \leq \bar{U}_0^T \bar{B} \quad (4.8)$$

і порівняємо (4.7) і (4.8). Оскільки

$$\bar{X}_0 \bar{A} \bar{U}_0^T = \left(\bar{X}_0^T \bar{A}^T \bar{U}_0 \right)^T, \quad \text{то} \quad \bar{U}_0^T \bar{B} \geq \bar{X}_0^T \bar{C},$$

або

$$\bar{U}_0 \bar{B}^T \geq \bar{X}_0 \bar{C}^T.$$

Зауваження. Теорема 4.1, зрозуміло, вірна й для оптимальних планів взаємно двоїстих задач: $\bar{U}^* \bar{B}^T \geq \bar{X}^* \bar{C}^T$, де \bar{X}^* і \bar{U}^* — будь-які оптимальні плани задач. Насправді, як буде видно з подальшого, справедлива рівність $\bar{U}^* \bar{B}^T = \bar{X}^* \bar{C}^T$.

Теорема 4.2. (друга теорема подвійності). Якщо для деяких припустимих планів \bar{X}_0 і \bar{U}_0 взаємно двоїстих задач виконується рівність

$$\bar{C}^T \bar{X}_0 = \bar{B}^T \bar{U}_0,$$

то \bar{X}_0 і \bar{U}_0 є оптимальними планами цих задач.

Доказ:

Відповідно до теореми 4 для всіх припустимих розв'язків \bar{X} і \bar{U} справедлива нерівність

$$\bar{C}^T \bar{X} \leq \bar{B}^T \bar{U},$$

але оскільки з умови теореми

$$\bar{C}^T \bar{X}_0 = \bar{B}^T \bar{U}_0,$$

то $\bar{C}^T \bar{X}_0$ – найбільше з можливих значень цільової функції, тобто

$$\bar{C}^T \bar{X} \leq \bar{C}^T \bar{X}_0$$

цільова функція від \bar{X}_0 – найбільша, таким чином, \bar{X}_0 є оптимальним значенням.

Аналогічно для цільової функції двоїстої задачі

$$\bar{B}^T \bar{U}_0 \leq \bar{B}^T \bar{U},$$

тобто $\bar{B}^T \bar{U}_0$ – найменше з можливих значень цільової функції двоїстої задачі, отже \bar{U}_0 – оптимальне значення.

Отже, якщо для деяких припустимих планів \bar{X}_0 і \bar{U}_0 прямої й двоїстої задач їх цільові функції рівні, то \bar{X}_0 й \bar{U}_0 – оптимальні плани пари сполучених задач.

Теорема 4.3. Якщо цільова функція в прямій задачі не обмежена зверху, то двоїста до неї задача не має припустимих планів.

Доказ.

Якщо припустити, що у двоїстій задачі існує хоча б один припустимий план \bar{U}_0 , то відповідно до теореми 4.2, для будь-якого припустимого плану \bar{X}_0 прямої задачі справедлива нерівність $\bar{C}^T \bar{X} \leq \bar{B}^T \bar{U} < +\infty$. Останнє означає, що цільова функція прямої задачі обмежена зверху. Оскільки це суперечить умові теореми, припущення про існування припустимих планів двоїстої задачі є невірним.

Наступне ствердження, відоме як **теорема рівноваги**, використовують при перевірці оптимальності планів ЗЛП.

Теорема 4.4. Нехай \bar{X}^* і \bar{U}^* — оптимальні плани канонічної й двоїстої щодо неї задач. Якщо j -та компонента плану \bar{X}^* строго додатна ($x_j^* > 0$), то відповідне j -е обмеження двоїстої задачі виконується як рівність: $a_{1j}u_1 + \dots + a_{mj}u_m = c_j$; якщо j -та компонента плану \bar{X}^* має нульове значення ($x_j^* = 0$), то j -е обмеження двоїстої задачі виконується як нерівність: $a_{1j}u_1 + \dots + a_{mj}u_m > c_j$.

Доказ.

Вектори \bar{X}^* і \bar{U}^* як припустимі плани, задовольняють обмеженням

$$\begin{aligned} \bar{A}\bar{X}^* &= \bar{B}; & \bar{X}^* > 0 & \text{- прямої задачі} \\ \bar{A}^T \bar{U}^* - \bar{C}^T &\geq 0; & \bar{U}^* > 0 & \text{- двоїстої задачі.} \end{aligned}$$

Запишемо скалярний добуток

$$\left(\overline{A}^T \overline{U} * -\overline{C}^T\right) \overline{X}^* = \overline{A}^T \overline{X}^* \overline{U} * -\overline{C}^T \overline{X}^* = \overline{B}^T \overline{U} * -\overline{C}^T \overline{X}^*.$$

Одержали різницю цільових функцій прямої і двоїстої задач. На підставі другої теореми подвійності оптимальні значення цільових функцій взаємно двоїстих задач збігаються. Отже скалярний добуток

$$\left(\overline{A}^T \overline{U} * -\overline{C}^T\right) \overline{X}^* = 0.$$

Але скалярний добуток двох невід'ємних векторів може дорівнювати нулю тільки в тому випадку, якщо всі попарні добутки їх відповідних координат дорівнюють нулю. Тоді, якщо $x_j > 0$, то $\sum_i a_{ij} u_i - c_j = 0$ або $\sum_i a_{ij} u_i = c_j$. А

якщо $x_j = 0$, то можливо, що $\sum_i a_{ij} u_i - c_j > 0$ або $\sum_i a_{ij} u_i > c_j$.

Практичне значення теорем подвійності полягає в тому, що вони дозволяють замінити процес розв'язання основної задачі на розв'язання двоїстої, який в певних випадках може виявитися простішим. Наприклад, задачу, область припустимих значень якої описується двома рівняннями, що зв'язують шість змінних ($m = 2, n = 6$), не можна вирішити графічним методом. Однак цей метод можна застосовувати для розв'язання двоїстої до неї задачі, що має тільки дві змінні.

Оптимальний розв'язок двоїстої задачі можна одержати з таблиці, отриманої на фінальній ітерації процедури симплекс-методу. Елементи індексного рядка цієї таблиці L_j обчислюють відповідно до виразу (2.9) $L_j = \sum_{i=1}^m c_j a_{ij}$, де c_j – елементи вектора-рядка, що містить коефіцієнти цільової функції прямої задачі при змінних, які є базисними в оптимальному плані; a_{ij} – елементи матриці \overline{D}^{-1} , що зворотна до матриці \overline{D} . Матриця \overline{D} складається з базисних векторів оптимального плану, компоненти яких узяті з початкового опорного плану задачі. Оптимальний план двоїстої задачі визначається співвідношенням

$$\overline{U}^* = \overline{C}_{j\text{баз}} \overline{D}^{-1}. \quad (4.9)$$

Зворотна матриця \overline{D}^{-1} завжди міститься в останній симплекс-таблиці в тих стовпчиках, де в першій таблиці задачі перебувала одинична матриця. (Нагадаємо, що добуток матриці на її зворотну дає одиничну матрицю, в якій діагональні елементи дорівнюють 1, а всі інші дорівнюють 0).

Отже, зв'язок між оптимальними розв'язками прямої й двоїстої задач і елементами індексних рядків L_j симплекс-таблиць, що відповідають цим розв'язкам, виражається наступними співвідношеннями:

$$\begin{aligned} a_{0,n+i}^{PP} &= u_i^*, \quad i = \overline{1, m}, \\ -a_{0,m+j}^{DB} &= x_j^*, \quad j = \overline{1, n}, \end{aligned}$$

де n – кількість змінних прямої задачі; m – кількість обмежень прямої задачі; $a_{0,n+i}^{PP}$ – $(n+i)$ -й елемент індексного рядка симплекс-таблиці прямої задачі, що

містить оптимальний план; $a_{0,m+j}^{ДВ}$ - $(m+j)$ -й елемент індексного рядка симплекс-таблиці двоїстої задачі, що містить оптимальний план.

4.3. Двоїсті оцінки і дефіцитність ресурсів

У різних джерелах компоненти оптимального плану двоїстої задачі називають **двоїстими оцінками** або **тіньовими цінами**.

На основі теорем подвійності для пари задач ЛП у загальній формі формулюють певні важливі з погляду економічної інтерпретації слідства. Зокрема, з теореми 4.4 випливає, що якщо при реалізації оптимального плану прямої задачі i -е обмеження виконується як строга нерівність, то оптимальне значення відповідної двоїстої змінної дорівнює нулю:

$$a_{i1}x_1^* + \dots + a_{in}x_n^* < b_i, \text{ то } u_i^* = 0.$$

Це означає, що якщо деякий ресурс b_i є в надлишковій кількості (не витрачається повністю при реалізації оптимального плану), то i -е обмеження стає несуттєвим, і тіньова оцінка такого ресурсу дорівнює нулю. Отже, тіньові оцінки характеризують **дефіцитність ресурсів**.

Якщо при реалізації оптимального плану двоїстої задачі j -е обмеження виконується як строга нерівність, то оптимальне значення відповідної змінної в оптимальному плані прямої задачі повинне дорівнювати нулю

$$a_{1j}u_1^* + \dots + a_{mj}u_m^* > c_j, \text{ то } x_j^* = 0.$$

Цей факт виражає **принцип рентабельності виробництва**. З огляду на економічний зміст двоїстих оцінок u_1^*, \dots, u_m^* , вираз $a_{1j}u_1^* + \dots + a_{mj}u_m^*$ може бути інтерпретованим як питомі витрати на j -й технологічний процес. Отже, якщо ці витрати перевищують прибуток від реалізації одиниці j -го продукту, виробництво j -го продукту є нерентабельним і не повинне бути присутнім в оптимальному виробничому плані ($x_j^* = 0$).

Незважаючи на можливі аналогії, які можуть виникнути у зв'язку з такими фундаментальними поняттями економічної теорії, як граничні витрати й граничний дохід, двоїсті оцінки не можна однозначно ототожнювати із цінами (хоча такі спроби іноді вживали на початковій стадії становлення дослідження операцій як науки).

Контрольні запитання

1. Поясніть суть подвійності в лінійному програмуванні.
2. Складіть просту економіко-математичну модель і запишіть до неї двоїсту. Дайте економічну інтерпретацію двоїстих оцінок.
3. Скільки змінних і обмежень має двоїста задача щодо прямої задачі?
4. Поясніть економічний зміст першої теореми подвійності.
5. Поясніть економічний зміст другої теореми подвійності.
6. У чому полягає економічний зміст третьої теореми подвійності?
7. Сформулюйте правила побудови двоїстих задач.
8. Як на підставі оптимального розв'язку прямої задачі одержати оптимальний розв'язок двоїстої задачі?

ТЕМА 5

АНАЛІЗ ЛІНІЙНИХ МОДЕЛЕЙ ЕКОНОМІЧНИХ ЗАДАЧ

5.1. Аналіз розв'язків лінійних економіко-математичних моделей

Традиційна економічна інтерпретація двоїстої задачі ЛП базується на моделі найпростішої задачі виробничого планування. В неї кожний j -й елемент вектора \bar{X} розглядається як план випуску продукції певного виду в натуральних одиницях, c_j — ціна одиниці продукції j -го виду, \bar{A}_j — вектор, що визначає технологію витрати наявних m ресурсів на виробництво одиниці продукції j -го виду, \bar{B} — вектор обмежень на обсяги цих ресурсів.

Припустимо, що для певних значень \bar{A}_j , \bar{B} і c_j знайдений оптимальний план x^* прямої задачі, що максимізує сумарний дохід $\max_{x \in D} \{cx\} = cx^*$, і визначені оптимальні оцінки сировини, тобто оптимальний план двоїстої задачі u^* . З виразу цільової функції двоїстої задачі $L^* = b_1 u_1^* + b_2 u_2^* + \dots + b_m u_m^*$ видно, що величина двоїстої оцінки u_i^* показує, наскільки зросте максимальне значення цільової функції прямої задачі при збільшенні кількості сировини відповідного виду на одну одиницю. Отже, змінні двоїстої задачі u_1^*, \dots, u_m^* за своїм змістом є оцінками потенційної можливості одержання додаткового прибутку за рахунок збільшення обсягу відповідного ресурсу в умовах оптимального функціонування керованого економічного об'єкта.

Виникає питання про те, як буде змінюватися оптимальний план x^* при зміні компонентів вектора обмежень \bar{B} і, зокрема, при яких варіаціях \bar{B} оптимальний план x^* залишиться оптимальним. Ця задача одержала назву проблеми **стійкості оптимального плану**. Очевидно, що дослідження стійкості x^* має й практичне значення, тому що в реальному виробництві обсяги доступних ресурсів b_i можуть істотно коливатися після ухвалення планового розв'язку x^* .

Коли вектор обмежень \bar{B} отримує приріст Δb , виникають відповідні варіації для оптимального плану прямої задачі $x^*(b + \Delta b)$ і значення цільової функції $L[x^*(b + \Delta b)]$. Припустимо, приріст Δb такий, що він не призводить до зміни оптимального базису задачі, тобто $x^*(b + \Delta b) \geq 0$. Введемо функцію $F(b)$, що повертає оптимальне значення цільової функції задачі для різних значень вектора обмежень \bar{B}

$$F(b) = \max_{x \in D(b)} \{cx\}. \quad (5.1)$$

Розглянемо відношення її приросту $F(b + \Delta b) - F(b)$ до приросту аргументу Δb . Якщо для деякого i спрямувати $\Delta b \rightarrow 0$, одержимо

$$\lim_{\Delta b_i \rightarrow 0} \frac{F(b + \Delta b) - F(b)}{\Delta b_i} = \frac{\partial F(b)}{\partial b_i}. \quad (5.2)$$

З огляду на те, що відповідно до теореми 4.2 цільові функції пари сполучених задач при оптимальних планах рівні між собою, запишемо

$$F(b) = \sum_{j=1}^n c_j x_j^* = \sum_{i=1}^m b_i u_i^* . \quad (5.3)$$

Підставимо (5.3) до (5.2) і одержимо вираз

$$\frac{\partial F(b)}{\partial b_i} = \frac{\partial \left(\sum_{i=1}^m b_i u_i^* \right)}{\partial b_i} = u_i^* \quad (5.4)$$

Теорема 5.1. В оптимальному плані двоїстої задачі значення змінної u_i^* чисельно дорівнює частинній похідній цільової функції L^* за відповідним аргументом b_i .

Звідси випливає економічна інтерпретація оптимальних змінних двоїстої задачі:

Кожний елемент u_1^*, \dots, u_m^* може розглядатися як гранична (миттєва) оцінка внеску i -го ресурсу в сумарний дохід L^* при оптимальному розв'язку x_1^*, \dots, x_n^* .

Інакше кажучи, u_i^* дорівнює приросту доходу, що виникає при збільшенні ресурсу i на одиницю за умови оптимального використання ресурсів.

Отже, якщо знайдено оптимальний план прямої задачі, можна провести аналіз стійкості двоїстих оцінок щодо змін компонентів вектора \bar{B} . Це дозволяє оцінити стійкість оптимального плану двоїстої задачі щодо зміни обмежень прямої задачі й ступінь впливу зміни \bar{B} на максимальне значення цільової функції, а також визначити найдоцільніший варіант можливих змін \bar{B} .

План двоїстої задачі не змінюється для всіх значень $b_i + \Delta b_i$, при яких стовпець вектора \bar{B}^* останньої симплекс-таблиці не містить від'ємних чисел, тобто коли серед компонентів вектора

$$\bar{B}^* = \begin{vmatrix} b_1 + \Delta b_1 \\ b_2 + \Delta b_2 \\ \dots\dots\dots \\ b_m + \Delta b_m \end{vmatrix} \quad (5.5)$$

немає від'ємних. \bar{B}^* – матриця, складена з компонентів векторів базису, що визначає оптимальний план задачі, оскільки базисні компоненти оптимального плану перебувають у стовпці вектора \bar{B} останньої симплекс-таблиці.

ресурсу можна визначити з умови:

(5.6)

мальний план, має вигляд

<i>Базис</i>	<i>Cj</i> _{баз}	<i>Cj</i>	6	5	0	0	0
		<i>B</i>	<i>A₁</i>	<i>A₂</i>	<i>A₃</i>	<i>A₄</i>	<i>A₅</i>
<i>A₁</i>	6	83	1	0	4/7	-3/7	0
<i>A₂</i>	5	36	0	1	-3/7	4/7	0
<i>A₅</i>	0	21	0	0	11/28	-11/7	1
<i>індексний рядок</i>	<i>Lj</i>	678	6	5	9/7	2/7	0
	<i>Δj</i>		0	0	9/7	2/7	0

ньова оцінка вища й відповідно сильніше впливає на величину цільової функції.

кількості сировини S_1 , дохід збільшиться на $\frac{9}{7}$ грн. Це відбудеться якщо виробницт-

ниці, при цьому витрата сировини S_3 зросте на $\frac{11}{28}$ одиниці. Новий оптимальний план

прямой задачі матиме вигляд $x^*=(83\frac{4}{7} ; 35\frac{4}{7} ; 0; 0; 20\frac{17}{28})$, а прибуток становитиме

до елементів стовпчика A_3 маємо

$$x^* = (83 + 0,57\Delta b_1; 36 - 0,43\Delta b_1; 0; 0; 21 + 0,39\Delta b_1).$$

Запишемо вектор \bar{B}^* з умовами його невід'ємності й визначимо межі припустимих значень Δb_1

$$\bar{B}^* = \left| \begin{array}{l} 83 + 0,57\Delta b_1 \geq 0 \\ 36 - 0,43\Delta b_1 \geq 0 \\ 21 + 0,39\Delta b_1 \geq 0 \end{array} \right| = \left| \begin{array}{l} \Delta b_1 \geq -66,7 \\ \Delta b_1 \leq 83,7 \\ \Delta b_1 \geq -53,8 \end{array} \right|$$

Оптимальний план двоїстої задачі залишиться незмінним, якщо Δb_1 належить інтервалу $-53,8 \leq \Delta b_1 \leq 83,7$, а перший ресурс $440 - 53,7 \leq b_1 \leq 440 + 83,7$ або $386,3 \leq b_1 \leq 523,7$.

Аналогічно для ресурсу 2 відповідно до елементів стовпчика A_4 запишемо $x^* = (83 - 0,43\Delta b_2; 36 + 0,57\Delta b_2; 0; 0; 21 - 1,57\Delta b_2)$.

$$\bar{B}^* = \left| \begin{array}{l} 83 - 0,43\Delta b_2 \geq 0 \\ 36 + 0,57\Delta b_2 \geq 0 \\ 21 - 1,57\Delta b_2 \geq 0 \end{array} \right| = \left| \begin{array}{l} \Delta b_2 \leq 193 \\ \Delta b_2 \geq -63,2 \\ \Delta b_2 \leq 13,4 \end{array} \right|$$

Оптимальний план двоїстої задачі залишиться незмінним, якщо Δb_2 належить інтервалу $-63,2 \leq \Delta b_2 \leq 13,4$, а другий ресурс $393 - 63,2 \leq b_2 \leq 393 + 13,4$ або $329,8 \leq b_2 \leq 406,4$.

Отже, якщо збільшення кількості ресурсів S_1 належить проміжку $-53,8 < \Delta b_1 < 83,7$, а кількість інших ресурсів незмінна, або збільшення кількості ресурсів S_2 належить проміжку $-63,2 < \Delta b_2 < 83,7$, а кількість інших ресурсів незмінна, то двоїста задача має той самий оптимальний план $u^* = (1,286; 0,286; 0)$.

Стосовно прямої задачі, можна показати, що при зміні кількості першого ресурсу S_1 у межах $386,3 \leq b_1 \leq 523,7$ можливий дохід підприємства лежить у межах $609,7 \leq L^* \leq 784,3$ а оптимальний план прямої задачі

$$(52,3; 59,1; 0; 0; 0,02) \leq x^* \leq (131; 0; 0; 0; 53,6).$$

При зміні кількості другого ресурсу S_2 у межах $329,8 \leq b_2 \leq 406,4$ можливий дохід підприємства лежить у межах $661 \leq L^* \leq 681,6$ а оптимальний план прямої задачі

$$(110; 0; 0; 0; 53,6) \leq x^* \leq (77; 43,6; 0; 0; 0).$$

Розраховані інтервали належать випадкам, коли змінюється тільки один ресурс. У випадку одночасної зміни обсягу всіх або кількох ресурсів для визначення нового оптимального плану використовують одне з основних співвідношень обчислювальної процедури симплекс-методу:

$$x^* = \bar{D}^{-1} * \bar{B}, \quad (5.7)$$

де \bar{D} - матриця, що складається з базисних векторів оптимального плану, ком-

поненти яких узяті з початкового опорного плану; \bar{B} - вектор обмежень.

У розглянутому числовому прикладі матриці \bar{D} й \bar{D}^{-1} відповідно мають вигляд

$$\bar{D} = \begin{vmatrix} 4 & 3 & 0 \\ 3 & 4 & 0 \\ 3 & 5 & 1 \end{vmatrix}; \quad \bar{D}^{-1} = \begin{vmatrix} 4/7 & -3/7 & 0 \\ -3/7 & 4/7 & 0 \\ 11/28 & -11/7 & 1 \end{vmatrix}$$

Нехай новий вектор обмежень

$$\bar{B} = \begin{vmatrix} 440+84 \\ 393+13,4 \\ 450+0 \end{vmatrix} = \begin{vmatrix} 524 \\ 406,4 \\ 450 \end{vmatrix};$$

тоді новий оптимальний план визначиться в такий спосіб

$$x^* = \begin{vmatrix} 4/7 & -3/7 & 0 \\ -3/7 & 4/7 & 0 \\ 11/28 & -11/7 & 1 \end{vmatrix} * \begin{vmatrix} 524 \\ 406,4 \\ 450 \end{vmatrix} = \begin{vmatrix} 125,26 \\ 7,66 \\ 17,2 \end{vmatrix}$$

Тобто $x^*=(125,26; 7,66; 0; 0; 17,2)$, при якому прибуток дорівнюватиме 790 грош. од.

5.2. Аналіз параметричної стійкості розв'язків ЗЛП

З погляду економічної інтерпретації задачу дослідження параметричної стійкості можна розглядати як вивчення тих меж коливання цін на продукцію керованого підприємства (фірми), при яких прийнятий план випуску продукції залишається оптимальним. Отже, питання стійкості оптимального плану ЗЛП може бути поставленим для випадку варіації коефіцієнтів цільової функції

$$c_j, \quad j = \overline{1, n}.$$

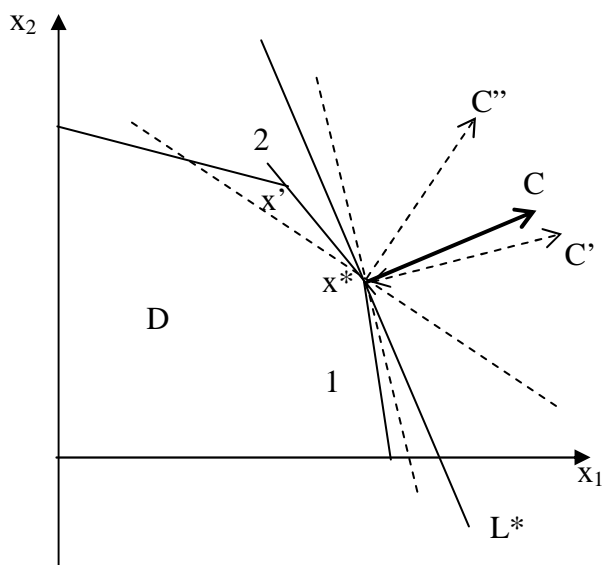


Рис. 5.1 – Графічна інтерпретація параметричної стійкості оптимального плану

Зміст проблеми стійкості оптимального плану ЗЛП стосовно варіацій цільової функції може бути проілюстрованим за допомогою першої геометричної інтерпретації. На рис. 5.1 зображена множина припустимих планів D деякої задачі ЛП. Як видно з рисунка, цільова функція L досягає екстремального значення в точці x^* , а зміні її коефіцієнтів від c до c' або c'' на рисунку відповідає поворот лінії рівня відносно x^* . Активним обмеженням (тобто таким, що звертаються на рівність) у точці x^* відповідають лінії 1 і 2. Доти, поки при повороті, викликаному зміною вектора c , лінія рівня цільової функції не виходить за

межі утворені лініями обмежень множини, x^* залишається оптимальним планом. Як показано на рис. 5.1, цей план не змінюється при переході від c до c' , і, навпаки, при переході від c до c'' лінія рівня цільової функції $L(x)=c''x$ перетинає лінію 2, що викличе зміну оптимального базисного плану, яким тепер стане точка x' . Використовуючи умови оптимальності плану ЗЛП

$$\Delta_i = L_i - c_i \geq 0, \quad (5.8)$$

можна одержати кількісні оцінки для меж коливань коефіцієнтів цільової функції, при яких не відбувається зміна оптимального плану. Припустимо, що варіації піддався певний елемент $c_r' = c_r + \Delta c_r$. Можливі два випадки:

1. Стовець r не входить до оптимального базису. Тоді для незмінності оптимального плану необхідно й достатньо виконання умови

$$\Delta_r' = L_r - c_r' \geq 0.$$

Звідси можна одержати значення для припустимої варіації

$$\Delta c_r \leq L_r - c_r. \quad (5.9)$$

2. Стовець r входить до оптимального базису. У цьому випадку для збереження оптимальності поточного плану буде потрібним виконання для всіх небазисних стовпців умов (5.8) або

$$\Delta_j = \sum_{i=1}^m c_{j_{\text{баз}}} a_{ij} - c_j \geq 0 \quad (5.10)$$

оскільки у цьому випадку зміни відбуваються також у стовпчику $C_{\text{баз}}$ симплекс-таблиці, а це, у свою чергу, стосується всіх ненульових оцінок Δ_j .

Отже, у цьому випадку припустима варіація повинна задовольняти умовам

$$\Delta c_r \leq \sum_{i=1}^m c_{j_{\text{баз}}} a_{ij} - c_j. \quad (5.11)$$

Повернемося до числового приклада й визначимо межі зміни параметрів цільової функції, при яких знайдений план $x^*=(83; 36; 0; 0; 21)$ залишається оптимальним. У цій задачі інтерес представляють варіації коефіцієнтів c_1 і c_2 , які стоять при базисних змінних в оптимальному плані.

Запишемо умови (5.11) для коефіцієнта c_1

$$\begin{cases} \Delta_3 = L_3 - c_3 = (6 + \Delta c_1) * 4/7 + 5 * (-3/7) + 0 * 11/28 - 0 = \frac{24}{7} + \frac{4}{7} \Delta c_1 - \frac{15}{7} \\ \Delta_4 = L_4 - c_4 = (6 + \Delta c_1) * (-3/7) + 5 * 4/7 + 0 * 11/7 - 0 = -\frac{18}{7} - \frac{3}{7} \Delta c_1 + \frac{20}{7} \end{cases} \Rightarrow$$

$$\begin{cases} \Delta_3 = \frac{24}{7} + \frac{4}{7} \Delta c_1 - \frac{15}{7} \geq 0 \\ \Delta_4 = -\frac{18}{7} - \frac{3}{7} \Delta c_1 + \frac{20}{7} \geq 0 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} \Delta c_1 \geq -\frac{9}{4} \\ \Delta c_1 \leq \frac{2}{3} \end{cases}.$$

$$-\frac{9}{4} \leq \Delta c_1 \leq \frac{2}{3}$$

$$3,75 \leq c_1 \leq 6,67.$$

Аналогічно визначимо варіацію коефіцієнта c_2 .

$$\begin{cases} \Delta_3 = L_3 - c_3 = 6 * 4/7 + (5 + \Delta c_2) * (-3/7) + 0 * 11/28 - 0 = \frac{9}{7} - \frac{3}{7} \Delta c_2 \\ \Delta_4 = L_4 - c_4 = 6 * (-3/7) + (5 + \Delta c_2) * 4/7 + 0 * (-11/7) - 0 = \frac{2}{7} + \frac{4}{7} \Delta c_2 \end{cases} \Rightarrow$$

$$\begin{cases} \Delta_3 = \frac{9}{7} - \frac{3}{7} \Delta c_2 \geq 0 \\ \Delta_4 = -\frac{2}{7} + \frac{4}{7} \Delta c_2 \geq 0 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} \Delta c_2 \leq 3 \\ \Delta c_2 \geq \frac{1}{2} \end{cases}$$

$$\frac{1}{2} \leq \Delta c_2 \leq 3$$

$$5,5 \leq c_2 \leq 8.$$

Наведений приклад дослідження чутливості оптимального плану щодо зміни параметрів задачі є простим. Існують і складніші задачі, в яких, наприклад, досліджуються спільні варіації параметрів різних типів. Вони складають предмет спеціального розділу дослідження операцій, що одержав назву параметричного програмування.

5.3. Оцінка рентабельності виробленої продукції

Оцінка рентабельності продукції, що випускається підприємством, ґрунтується на теоремі рівноваги, (теоремі 4.4) і виконується за допомогою двоїстих оцінок і обмежень двоїстої задачі, що характеризують кожний вид продукції. З цієї теореми випливає, що кількість продукції, витрати на виробництво якої перевищують дохід, в оптимальному плані дорівнює нулю.

Якщо при підстановці u^* до системи обмежень двоїстої задачі вартість ресурсів, що витрачаються на одиницю продукції (ліва частина), перевищує ціну цієї продукції (права частина), то виробництво такої продукції для підприємства недоцільно. Тобто у цьому випадку цей вид продукції є нерентабельним. Якщо співвідношення виконується як рівність, продукція є рентабельною.

Аналогічні результати можна одержати, якщо проаналізувати симплекс-різниці Δ_j у стовпчиках, які відповідають досліджуваним видам продукції. Їх значення показують, наскільки вартість ресурсів перевищує ціну одиниці відповідної продукції. Так, якщо симплекс-різниця дорівнює нулю $\Delta_j = 0$, то продукція є рентабельною. І, навпаки, якщо $\Delta_j \neq 0$, то відповідна продукція нерентабельна. Помітимо також, що індексний рядок останньої симплекс-таблиці містить значення додаткових змінних двоїстої задачі u^* . Отже, якщо вони перевищують ціну продукції відповідного виду, то цей вид продукції є рентабельним.

Звернемося до числового прикладу. Підставимо отримані тіньові оцінки в обмеження двоїстої задачі:

$$\begin{cases} 4 \cdot \frac{9}{7} + 3 \cdot \frac{2}{7} + 3 \cdot 0 = 6 & \text{продукція A є рентабельною} \\ 3 \cdot \frac{9}{7} + 4 \cdot \frac{2}{7} + 5 \cdot 0 = 5 & \text{продукція B є рентабельною} \end{cases}.$$

Оскільки обоє обмеження виконуються як строгі рівності, обидва види продукції A і B є рентабельними. Це підтверджується і тим, що в оптимальному плані $x^*=(83; 36; 0; 0; 21)$ обидва елементи x_1 і x_2 , що відповідають обсягам виробництва, не нульові.

Проаналізуємо додаткові змінні двоїстої задачі, які розміщуються в індексному рядку симплекс-таблиці в стовпчиках A_1 і A_2 . Їх оптимальні значення $u_4=6$; $u_5=5$. Відповідно симплекс-різниці $\Delta_1 = \Delta_2 = 0$, що також свідчить про рентабельність продукції A і B.

5.4. Аналіз обмежень дефіцитних і недефіцитних ресурсів

Статус ресурсів прямої задачі можна визначити трьома способами. Перший - підстановкою x^* до системи обмежень прямої задачі. Якщо обмеження виконується як рівність, то відповідний ресурс є дефіцитним, у протилежному випадку - недефіцитним.

Другий спосіб - за допомогою додаткових змінних прямої задачі. Якщо додаткова змінна в оптимальному плані дорівнює нулю, то відповідний ресурс дефіцитний, а якщо відмінна від нуля - ресурс недефіцитний.

Третій спосіб — за допомогою двоїстих оцінок. Якщо $u_i \neq 0$, то зміна (збільшення або зменшення) обсягів i -го ресурсу призводить до відповідної зміни доходу підприємства, і тому такий ресурс є дефіцитним. Якщо $u_i=0$, то i -й ресурс недефіцитний.

Звернемося до числового прикладу. Підставимо компоненти оптимального плану $x^*=(83; 36; 0; 0; 21)$ до системи обмежень прямої задачі:

$$\begin{cases} 4 \cdot 83 + 3 \cdot 36 = 440 & \text{ресурс витрачено повністю} \\ 3 \cdot 83 + 4 \cdot 36 = 393 & \text{ресурс витрачено повністю} \\ 3 \cdot 83 + 5 \cdot 36 = 429 & \text{ресурс витрачено не повністю} \end{cases}.$$

Змінні $u_1 = 1,286$ і $u_2 = 0,286$ є умовними двоїстими оцінками одиниці сировини S_1 і S_2 відповідно. Ці оцінки відмінні від нуля, а сировина S_1 і S_2 повністю витрачається при оптимальному плані виробництва виробів A і B. Двоїста оцінка одиниці сировини S_3 $u_3=0$. Цей вид сировини не витрачається повністю при оптимальному плані виробництва.

Отже, додатну двоїсту оцінку мають лише ті види сировини, які повністю витрачаються при оптимальному плані виробництва. Тому двоїсті оцінки ви-

значають *дефіцитність* використовуваної підприємством сировини.

$$\begin{cases} u_1 = 1,286 \\ u_2 = 0,286 \\ u_3 = 0 \end{cases} \begin{array}{l} \text{ресурс 1 дефіцитний} \\ \text{ресурс 2 дефіцитний} \\ \text{ресурс 3 недефіцитний} \end{array} .$$

Контрольні запитання

1. У чому полягає економічна інтерпретація прямої й двоїстої задач лінійного програмування?
2. Як визначити, чи є ресурс дефіцитним?
3. Як визначити, що продукція є рентабельною або нерентабельною?
4. У чому полягає економічний зміст змінних двоїстої задачі?
5. Який зміст вкладають у поняття «параметрична стійкість»?
6. Сформулюйте умови для припустимих змін цільової функції задачі, при яких її оптимальний план залишається незмінним.
7. Як визначити статус ресурсів прямої задачі?
8. Як визначити інтервали стійкості двоїстих оцінок щодо зміни запасів дефіцитних ресурсів?
9. Як визначити оптимальний план виробництва продукції й зміну доходу підприємства при збільшенні або зменшенні обсягу ресурсів?
10. Як розрахувати інтервали можливої зміни ціни одиниці кожного виду продукції?

ЗМ 3. Вибрані розділи математичного програмування

ТЕМА 6. ЦІЛОЧИСЛОВІ ТА ДРІБНО-ЛІНІЙНІ ЗАДАЧІ ЛІНІЙНОГО ПРОГРАМУВАННЯ

6.1. Типи задач дискретного програмування

Цілочислове лінійне програмування орієнтоване на розв'язання задач лінійного програмування, в яких всі або деякі змінні повинні приймати цілочислові (або дискретні) значення. Багато економічних задач характеризуються тим, що обсяги керованих ресурсів можуть приймати тільки цілі значення. До цілочислового програмування належать також задачі, у яких змінні можуть приймати тільки два значення – 0 або 1 (булеві або бінарні змінні). До задач цілочислового програмування належать задачі про призначення, про найкоротший шлях та інші. У загальному вигляді задачу цілочислового програмування можна сформулювати як задачу знаходження максимуму (або мінімуму) цільової функції $L(x_1, x_2, \dots, x_n)$ на множині D , зумовленій системою обмежень. Загальну задачу цілочислового програмування формулюють в такий спосіб

Знайти найбільше або найменше значення лінійної функції

$$L = \sum_{j=1}^n c_j x_j \rightarrow \text{extr} \quad (6.1)$$

за умови

$$\sum_{j=1}^n a_{ij} x_j = b_i; \quad i = \overline{1, m} \quad (6.2)$$

$$x_j \geq 0, \quad x_j - \text{цілі}, \quad j = \overline{1, n}.$$

Умову $x_j - \text{цілі}$ називають умовою дискретності. Особливе місце серед дискретних задач займає цілочислова задача лінійного програмування в канонічній формі (ЦКЗЛП). У певних ситуаціях вимога «цілочислове» може бути накладена лише на певні змінні x_j , що кардинально не змінює характеру задачі.

Принципова складність, викликувана наявністю умов цілочисловості в системі обмежень оптимізаційної задачі, полягає в тому, що в значній кількості випадків неможливо замінити дискретну задачу її безперервним аналогом і, знайшовши відповідний розв'язок, округлити його компоненти до найближчих цілих значень. На рис. 6.1 показано, що при округленні оптимального плану x^* звичайної задачі ЛП до цілих значень виходить точка B , що не належить області припустимих планів. Якщо навіть оптимальний план безперервної задачі, округлений до цілих значень компонент, виявиться припустимим, то цільова функція може поводитися так, що її значення буде на ньому істотно «гірше», ніж на оптимальному плані цілочислової задачі.

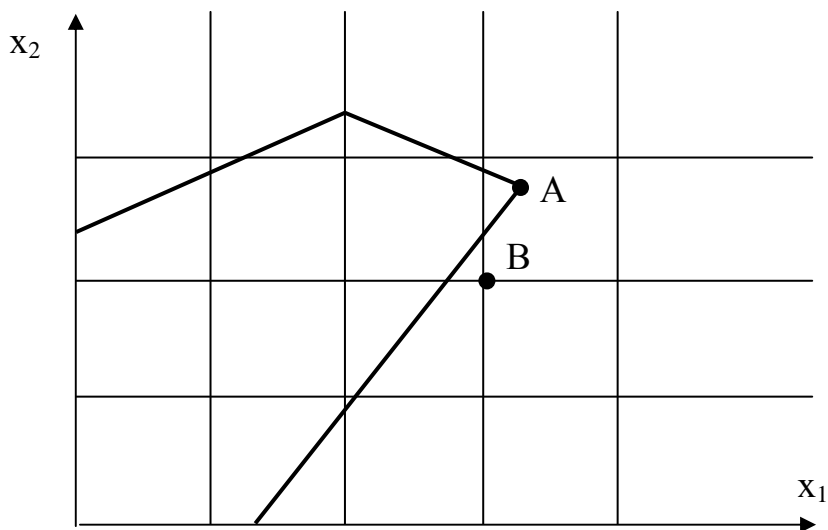


Рис. 6.1 – Розв'язок цілочислової задачі

Перелічені проблеми визначили необхідність розробки спеціальних методів розв'язання дискретних і цілочислових задач.

У літературі, як правило, виділяють наступні класи дискретних оптимізаційних задач:

- задача з неділимостями;
- екстремальні комбінаторні задачі;
- задачі з розривними цільовими функціями;
- задачі на незв'язних і неопуклих областях та ін.

Задача з неділимостями. У переважній більшості випадків наявність умов неділимості визначається фізичними властивостями об'єктів, наприклад, вони можуть з'явитися як додаткові обмеження в задачі виробничого планування, якщо в ній здійснюється керування випуском великої штучної продукції. Класичним представником задач даного класу є так звана задача про ранець. Вона полягає в тому, що солдат (або турист), що збирається в похід, може нести вантаж вагою не більш за W кг. Цей вантаж може складатися з набору предметів n типів, кожний предмет j -го типу важить w кг і характеризується певною «корисністю». Треба визначити, скільки предметів кожного виду потрібно покласти в ранець, щоб його сумарна корисність була максимальною. До такого формулювання можуть бути зведені багато економічних задач. У літературі ця задача також відома як задача про завантаження судна.

Комбінаторні задачі. До даного класу належать задачі з оптимізації функції, заданої на кінцевій множині, елементами якої служать вибірки з n об'єктів. Класичним представником такої задачі є задача про комівояжера. Вона полягає в складанні маршруту відвідування торговим агентом, що перебуває в деякому початковому пункті, n інших міст за умови, що задано матрицю вартостей переїздів з одного міста до іншого. Причому припустимим є маршрут, що передбачає однократне відвідування всіх міст і повернення у вихідний пункт. Найкращий маршрут повинен мінімізувати сумарну вартість переїздів. Кожний припустимий маршрут можна ототожнити з перестановкою n чисел. Задача комівояжера має велику кількість змістовних аналогів. Зокрема, задача розробки графі-

ка переналагодження устаткування, що може випускати різні типи виробів, але вимагає певних витрат (часових або матеріальних) при переході з одного технологічного режиму на інший.

Задача з розривними цільовими функціями. Багато економічних систем характеризуються наявністю так званих постійних витрат, які мають місце незалежно від обсягу виробництва. Врахування у моделях цих і подібних факторів призводить до появи в них цільових функцій, що не є безперервними. Як приклад можна навести транспортну задачу з фіксованими доплатами. У цьому випадку цільова функція сумарних витрат на перевезення містить «стрибкоподібні» розриви, що істотно утрудняє її мінімізацію.

Методи розв'язання задач цілочислового лінійного програмування засновані на використанні обчислювальних можливостей методів лінійного програмування. Зазвичай алгоритми цілочислового програмування включають три кроки:

1. «Ослаблення» простору припустимих розв'язків задачі шляхом відкидання вимоги цілочисловості. У результаті виходить звичайна задача лінійного програмування.

2. Визначення оптимального розв'язку задачі лінійного програмування.

3. Маючи отриманий оптимальний розв'язок, додають спеціальні обмеження, які ітераційним шляхом змінюють простір припустимих розв'язків задачі лінійного програмування так, щоб в остаточному підсумку вийшов оптимальний розв'язок, що задовольняє вимогам цілочисловості.

Розроблено два методи побудови спеціальних обмежень:

- метод Гоморі (або метод площин, що відсікають, він був уперше запропонованим Р. Гоморі у 1957-1958 р.);
- метод віток і границь.

Помітимо також, що досить ефективний і широко застосовуваний підхід до розв'язання цілочислових задач заснований на зведенні їх до задач транспортного типу. Це пояснюється тим, що якщо в умовах транспортної задачі значення запасів і потреб є цілочисловими, то цілочисловим буде й оптимальний план.

6.2. Метод Гоморі

Сутність методу Гоморі полягає в тому, що спочатку задачу вирішують без урахування умови цілочисловості. Якщо отриманий у результаті оптимальний план x^* містить тільки цілі компоненти, задачу вирішено. У протилежному випадку до системи обмежень задачі додають нове обмеження, що має наступні властивості:

- воно повинне бути лінійним;
- повинне відсікати знайдений нецілочисловий оптимальний план x^* ;
- не повинне відсікати жодного цілочислового плану.

Додаткове обмеження, що має зазначені властивості, називають **правильним відсіканням**. Далі задачу вирішують з урахуванням нового обмеження. Після цього, якщо буде потреба, додається ще одне обмеження й т.д.

одержання припустимого базисного розв'язку потрібно перевести в базисні змінні одну з вільних змінних.

4. Отриману розширену задачу вирішити симплексним методом. Якщо знайдений оптимальний план буде цілочисловим, то задачу цілочислового програмування вирішено. У протилежному випадку треба повернутися до п.2 алгоритму.

Якщо задачу розв'язано в цілих числах, то після кінцевого числа кроків оптимальний цілочисловий план буде знайденим.

Якщо в процесі розв'язання з'явиться рівняння (що виражає базисну змінну через вільні) з нецілим вільним членом і цілими іншими коефіцієнтами, то відповідне рівняння не має розв'язання в цілих числах. У цьому випадку й задача не має цілочислового оптимального розв'язку.

Розглянемо особливості застосування методу Гоморі на прикладі. Нехай дано задачу з наступними умовами:

$$\begin{aligned} L &= 3x_1 + x_2 + 2x_3 \rightarrow \max \\ x_1 + 2x_2 + 4x_3 &= 9 \\ 3x_1 + x_2 + 5x_3 &= 10 \\ x_j &\geq 0; \quad x_j - \text{цілі}; \quad j = \overline{1,3} \end{aligned}$$

Використовуючи звичайний симплекс-алгоритм, вирішуємо безперервний аналог вихідної задачі, в якій ігноруються умови цілочисловості. Як вихідний базис можна взяти перший і другий стовпці. На його основі заповнюємо симплекс-таблицю:

Базис	$C_{\text{баз}}$	C_j	3	1	2
		B	A_1	A_2	A_3
A_1	3	11/5	1	0	6/5
A_2	1	17/5	0	1	7/5
L_j		10	3	1	5
Δ_j			0	0	3

Як видно з рядка оцінок, цей базис є оптимальним, однак відповідний йому план $x^* = \left(\frac{11}{5}; \frac{17}{5}; 0\right)$ не є цілочисловим, тому вибираємо рядок, що містить перший нецілий елемент, і відповідно до формули (6.4) будуємо відсікаюче обмеження:

$$\left\{\frac{11}{5}\right\} - \left\{\frac{6}{5}\right\}x_3 \leq 0.$$

Увівши додаткову цілочислову змінну $x_4 \geq 0$, одержимо рівносильне нерівності рівняння

$$-\frac{1}{5}x_3 + x_4 = -\frac{1}{5},$$

яке необхідно включити до системи обмежень. Введемо його до симплекс-таблиці

Базис	$C_{\text{баз}}$	C_j	3	1	2	0
		B	A_1	A_2	A_3	A_4
A_1	3	11/5	1	0	6/5	0
A_2	1	17/5	0	1	7/5	0
A_4	0	-1/5	0	0	-1/5	1
L_j		10	3	1	5	0
Δ_j			0	0	3	0

Врахуємо, що отриманий базисний розв'язок є неприпустимим (компонента b_3 від'ємна). Для одержання припустимого базисного розв'язку переведемо в базисні змінні вільну змінну x_3 .

Базис	$C_{\text{баз}}$	C_j	3	1	2	0
		B	A_1	A_2	A_3	A_4
A_1	3	1	1	0	0	6
A_2	1	2	0	1	0	7
A_3	2	1	0	0	1	-5
L_j		7	3	1	2	15
Δ_j			0	0	0	15

Отриманий план $x^*=(1, 2, 1, 0)$ є не тільки оптимальним (всі $b_j>0$), але й повністю складається з цілочислових компонент, тобто розв'язок задачі знайдено, $\max L = 7$.

6.3. Метод віток і границь

Метод віток і границь - один з комбінаторних методів. Його суть полягає у впорядкованому переборі варіантів і розгляді тих з них, які за певними ознаками є перспективними. Вперше цей метод запропонували в 1960 р. Ленг і Дойг, а його «друге народження» відбулося в 1963 р. у зв'язку з виходом роботи Літгла, Мурті, Суїні й Керел, присвяченої розв'язанню задачі про комівояжера.

Метод віток і границь полягає в тому, що множину припустимих розв'язків (планів) за певним способом розбивають на підмножини, кожен з яких за тим самим способом знову розбивають на підмножини. Процес триває доти, поки не буде отриманий оптимальний цілочисловий розв'язок вихідної задачі.

Якщо задача максимізації лінійної функції L вирішена за симплексним методом без урахування цілочисловості змінних, то стають відомими нижня й верхня границя для кожної цілочислової змінної x_j : $[x_j]<x_j<[x_j]+1$ і нижня границя лінійної функції L_0 , тобто при будь-якому плані x $L(x)\geq L_0$. Тоді з області припустимих значень, наприклад, змінної x_r виключають область $[x_r]<x_r<[x_r]+1$, де $[x_r]$ – ціла частина числа x_r . В результаті це дозволяє сформулювати дві зада-

чі, що відрізняються тим, що в одну з них додано обмеження $x_r \leq [x_r]$, а в іншу – обмеження $x_r \geq [x_r]+1$.

Сформульовані задачі вирішують у будь-якому порядку. Залежно від отриманого розв'язку список таких задач може розширюватися або зменшуватися. Якщо в ході розв'язання будь-якої із задач отриманий нецілочисловий оптимальний план, для якого $L(x) \leq L_0$, то цю задачу виключають зі списку. Якщо $L(x) \geq L_0$, то з цієї задачі формують дві нові задачі.

Розглянемо приклад:

$$\begin{aligned} L &= 5x_1 + 4x_2 \rightarrow \max \\ x_1 + x_2 &\leq 5 \\ 10x_1 + 6x_2 &\leq 45 \\ x_j &\geq 0; \quad x_j - \text{ц\i лые}; \quad j = \overline{1,2} \end{aligned} .$$

Вирішимо задачу шляхом відкидання умов цілочисловості. Використаємо функцію Excel «Пошук рішення» і одержимо

$$x_1=3,75; x_2=1,25; L=23,75.$$

Виберемо одну із цілочислових змінних, значення якої в оптимальному розв'язку не є цілочисловим, наприклад, x_1 . Очевидно, що область $3 < x_1 < 4$ простору припустимих розв'язків не містить цілочислових значень змінної x_1 , і отже може бути виключена з розгляду. Це еквівалентно заміні вихідної задачі двома новими задачами. В одну з них додамо обмеження $x_1 \leq 3$, одержимо

$$\begin{aligned} L &= 5x_1 + 4x_2 \rightarrow \max \\ x_1 + x_2 &\leq 5 \\ 10x_1 + 6x_2 &\leq 45 \\ x_1 &\leq 3 \\ x_j &\geq 0; \quad x_j - \text{ц\i ли}; \quad j = \overline{1,2} \end{aligned} .$$

Використовуючи функцію Excel «Пошук рішення», дістанемо оптимальний цілочисловий план

$$x_1=3; x_2=2; L=23.$$

Якість отриманого цілочислового розв'язку оцінити неможливо, скільки розв'язок другої задачі може привести до більшого значення цільової функції. Це треба перевірити. Сформулюємо другу задачу, додавши до неї обмеження $x_1 \geq 4$:

$$\begin{aligned} L &= 5x_1 + 4x_2 \rightarrow \max \\ x_1 + x_2 &\leq 5 \\ 10x_1 + 6x_2 &\leq 45 \\ x_1 &\geq 4 \\ x_j &\geq 0; \quad x_j - \text{ц\i ли}; \quad j = \overline{1,2} \end{aligned} .$$

В оптимальному розв'язку другої задачі змінна x_2 не є цілим числом:

$$x_1=4; x_2=0,83; L=23,33.$$

Оскільки значення змінної $x_2=0,83$ не є цілим числом, другу задачу необхідно досліджувати далі, розділивши її у свою чергу ще на дві задачі і т.д. Проілюструємо хід розв'язання схемою, наведеною на рисунку 6.2.

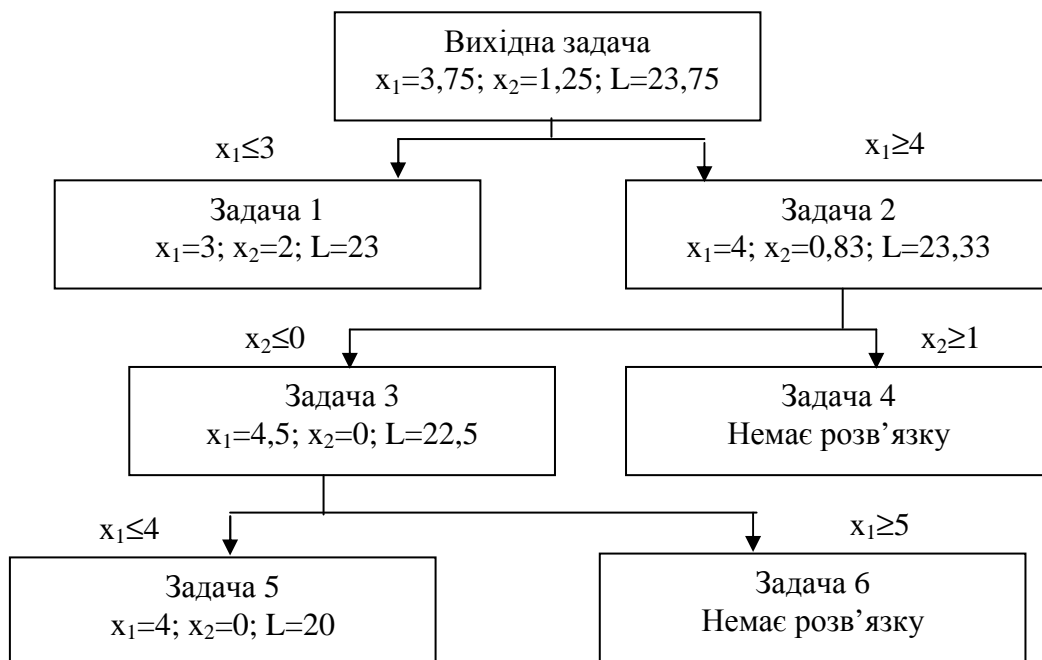


Рис. 6.2 – Схема методу віток і границь

У ході розв'язання можна було спочатку як змінну розгалуження прийняти x_2 . При цьому наступні обчислення можуть значно відрізнятись.

Очевидним недоліком алгоритму методу віток і границь при розв'язанні задач великої розмірності є необхідність перебрати занадто велику кількість варіантів, перш ніж буде знайдений оптимальний план.

6.4. Дрібно-лінійне програмування

В економічних задачах оптимізації цільова функція можна представити у вигляді дрібно-лінійної функції. Це має місце, зокрема, якщо критерієм оптимальності є продуктивність праці або показник рентабельності та ін. У цих випадках загальна економіко-математична модель має вигляд:

$$\text{Знайти} \quad Z = \frac{\sum_{j=1}^n c_j x_j + c_0}{\sum_{j=1}^n d_j x_j + d_0} \rightarrow \text{extr} \quad (6.5)$$

за умови

$$\begin{aligned} \sum_{j=1}^n a_{ij} x_j &= b_i, \quad i = \overline{1, m}, \\ x_j &\geq 0, \quad j = \overline{1, n} \end{aligned} \quad (6.6)$$

причому, знаменник дробу не може дорівнювати нулю в області припустимих розв'язків системи обмежень.

Для розв'язання задачі дрібно-лінійного програмування її зводять до задачі лінійного програмування шляхом заміни змінних. Позначимо

$$\sum_{j=1}^n d_j x_j + d_0 = \frac{1}{s_0}, \quad (6.7)$$

тоді $s_j = s_0 x_j$, $j = \overline{1, n}$. Одержимо перетворену модель задачі лінійного програмування:

$$\text{Знайти} \quad L = \sum_{j=1}^n c_j s_j + x_0 s_0 \rightarrow \text{extr} \quad (6.8)$$

за умови

$$\begin{aligned} \sum_{j=1}^n a_{ij} s_j - b_i s_0 &= 0, \quad i = \overline{1, m}, \\ \sum_{j=1}^n d_j s_j + d_0 s_0 &= 1, \\ s_j &\geq 0, \quad j = \overline{1, n}; \quad s_0 > 0 \end{aligned} \quad (6.9)$$

Після визначення оптимального плану задачі лінійного програмування $s^* = (s_1, s_2, \dots, s_n)$, наприклад, за допомогою симплекс-методу, компоненти оптимального плану дрібно-лінійної задачі визначають за формулою

$$x_j = \frac{s_j}{s_0}, \quad j = \overline{1, n}. \quad (6.10)$$

Контрольні запитання

1. Які основні проблеми виникають при розв'язанні дискретних задач?
2. Сформулюйте задачу про ранець.
3. Які економіко-математичні моделі можна звести до задачі про комівояжера?
4. Наведіть приклади моделей з розривними цільовими функціями.
5. Який принцип використовують для побудови правильного відсікання в методі Гоморі?
6. Яку роль відіграє алгоритм двоїстого симплекс-методу при розв'язанні цілочислової лінійної задачі за методом Гоморі?
7. Перелічіть принципові ідеї, що лежать в основі методів віток і границь.
8. Як провадиться побудова відсікання при розв'язанні цілочислової лінійної задачі за методом віток і границь?
9. Опишіть схему розв'язання цілочислової задачі лінійного програмування за методом віток і границь.
10. За рахунок яких перетворень вдається побудувати сполучений базис при додаванні відсікаючого обмеження?
11. Сформулюйте задачу дрібно-лінійного програмування.
12. Охарактеризуйте метод розв'язання дрібно-лінійних задач.

ТЕМА 7. НЕЛІНІЙНЕ ПРОГРАМУВАННЯ

7.1. Постановка задачі нелінійного програмування (ЗНП)

Залежності між керованими змінними далеко не завжди можна описати за допомогою адекватної лінійної моделі. Наприклад, у лінійних моделях ціну товару вважають незалежною від кількості реалізованого продукту, у той час як вона може залежати від обсягу партії товару. З приводу технологічних обмежень можна помітити, що витрата певних видів сировини й ресурсів відбувається не лінійно, а стрибкоподібно (залежно від обсягу виробництва). Спроби врахувати ці фактори приводять до формулювання загальніших і складніших оптимізаційних задач. Вивчення методів їх розв'язання складає предмет наукової області, що одержала назву *нелінійного програмування*.

Для задач нелінійного програмування не існує універсального методу розв'язання, тому щораз необхідно доводити існування розв'язку задачі, а також його одиничність. Відомі точні методи розв'язання нелінійних задач, але алгоритми їх розв'язання є трудомісткими навіть для сучасного програмного забезпечення ЕОМ. На практиці частіше користуються наближеними методами, проблема яких пов'язана з пошуком локальних і глобальних оптимумів. Більшість наближених методів дозволяють визначити локальний оптимум. Визначивши всі локальні оптимуми й порівнявши їх, можна знайти глобальний оптимум. Але такий підхід не є ефективним для практичних розрахунків. Слід зазначити, що якщо в задачах лінійного програмування оптимальний розв'язок завжди перебував на границі області обмежень, то в задачі нелінійного програмування він може перебувати також і усередині цієї області.

У класичній теорії оптимізації для пошуку точок максимуму й мінімуму (екстремальних точок) функцій, як при відсутності, так і при наявності обмежень на змінні використовують апарат диференціального обчислення. Екстремальна точка функції $f(x)$ визначає або її максимальне, або мінімальне значення. З математичної точки зору точка $x_0 = (x_1, x_2, \dots, x_n)$ є точкою максимуму, якщо значення функції f в оточенні точки x_0 не перевищують $f(x_0)$. На рис. 7.1 показані точки максимуму й мінімуму функції однієї змінної $f(x)$. Точки x_1, x_2, x_3, x_4 і x_6 складають множину екстремальних точок функції $f(x)$. Причому точка x_6 є точкою **глобального (абсолютного)** максимуму, тому що $f(x) = \max\{f(x_1), f(x_3), f(x_6)\}$, а точки $f(x_1)$ і $f(x_3)$ – точками **локального (відносного)** максимуму. Необхідною умовою існування екстремуму є рівність нулю похідних від $f(x)$. Але похідні дорівнюють нулю також і в точках перегину функції $f(x)$ у випадку однієї змінної (точка x_5), і в сідлових точках у випадку функції двох змінних. Тому рівність нулю похідних від $f(x)$ є необхідною, але недостатньою умовою існування екстремуму, а точки, у яких виконується дана умова, називають **стаціонарними**.

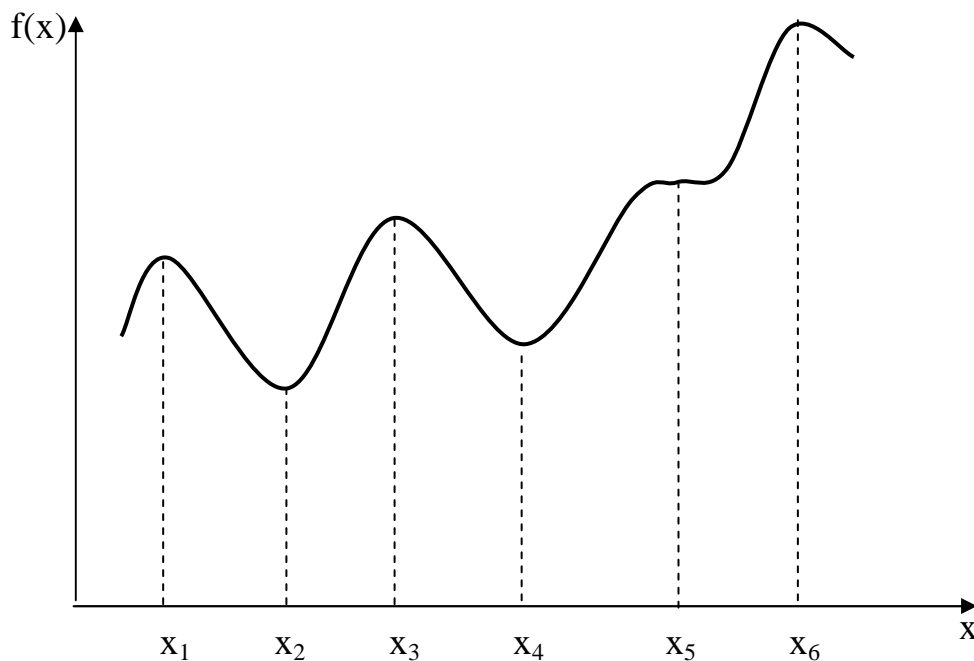


Рис. 7.1 – Точки максимуму і мінімуму функції

Більшість методів, використовуваних для розв'язання задач нелінійного програмування, базуються на теорії диференціального обчислення. Серед них розрізняють **прямі** й **непрямі** методи. За прямими методами пошук оптимуму ведеться в напрямку найшвидшого зростання або убуття цільової функції. До таких методів належать градієнтні методи, зокрема, метод найшвидшого спуску й метод припустимих напрямків. Непрямі методи припускають перетворення вихідної задачі до виду, що дозволяє спростити пошук екстремуму цільової функції. До них належить квадратичне програмування й сепарабельне програмування, а також геометричне й стохастичне програмування.

Загальну задачу нелінійного програмування (ЗНП) визначають як задачу із знаходження максимуму (або мінімуму) цільової функції $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$ на множині D , зумовленій системою обмежень

$$\begin{aligned}
 g_1(x_1, x_2, \dots, x_n) &\leq 0 \\
 g_2(x_1, x_2, \dots, x_n) &\leq 0 \\
 &\dots\dots\dots \\
 g_i(x_1, x_2, \dots, x_n) &\leq 0 \\
 g_{i+1}(x_1, x_2, \dots, x_n) &\leq 0 \\
 &\dots\dots\dots \\
 g_m(x_1, x_2, \dots, x_n) &= 0 \\
 x_j &\geq 0, \quad j = \overline{1, n}
 \end{aligned} \tag{7.1}$$

де хоча б одна з функцій f або g_i є нелінійною.

Очевидно, що питання про тип оптимізації не є принциповим. Тому, для визначеності, надалі будемо розглядати задачі максимізації.

Як і в ЗЛП, вектор $x^* = (x_1, x_2, \dots, x_n) \in D$ називають *припустимим планом*, а якщо для будь-якого $x \in D$ виконується нерівність $f(x^*) \geq f(x)$, то x^* називають *оптимальним планом*. У цьому випадку x^* є точкою глобального максимуму.

З погляду економічної інтерпретації $f(x)$ може розглядатися як дохід, що одержує підприємство при плані випуску x , а $g_i(x) < 0$ як технологічні обмеження на можливості випуску продукції.

Набір обмежень, що визначають множину D , при необхідності завжди можна звести або до системи, що складається з одних нерівностей, або, додавши фіктивні змінні, до системи рівнянь. Перелічимо властивості ЗНП, які істотно ускладнюють процес їх розв'язання порівняно із задачами лінійного програмування.

1. Множина припустимих планів D може мати дуже складну структуру (наприклад, бути неопуклою або незв'язною).

2. Глобальний максимум (мінімум) може досягатися як усередині множини D , так і на її границях (де він, загалом кажучи, буде не збігатися з жодним з локальних екстремумів).

3. Цільова функція f може бути недиференційованою, що утруднює застосування класичних методів математичного аналізу.

У чинність названих факторів задачі нелінійного програмування настільки різноманітні, що для них не існує загального методу розв'язання.

7.2. Класичний метод оптимізації з використанням множників Лагранжа

Одним з найзагальніших підходів до розв'язання задач з пошуку екстремуму функції при наявності сполучних обмежень на її змінні (*задача умовної оптимізації*) є **метод Лагранжа**. Багатьом студентам він повинен бути відомим з курсу диференціального обчислення. Ідея даного методу полягає у зведенні задачі пошуку умовного екстремуму цільової функції

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) \quad (7.2)$$

на множині припустимих значень D , описуваній системою рівнянь

$$\begin{aligned} g_1(x_1, x_2, \dots, x_n) &= 0 \\ g_2(x_1, x_2, \dots, x_n) &= 0 \\ &\dots\dots\dots \\ g_m(x_1, x_2, \dots, x_n) &= 0 \end{aligned} \quad (7.3)$$

до задачі безумовної оптимізації функції

$$\Phi(x, \lambda) = f(x_1, x_2, \dots, x_n) + \lambda_1 g_1(x_1, x_2, \dots, x_n) + \dots + \lambda_m g_m(x_1, x_2, \dots, x_n), \quad (7.4)$$

де λ_i — вектор додаткових змінних, названих *невизначеними множниками Лагранжа*. Рівняння (7.3) називають *рівняннями зв'язку*, а функція $\Phi(x, \lambda)$ — *функцією Лагранжа*.

Для функції $\Phi(x, \lambda)$ вирішують систему рівнянь

$$\begin{cases} \frac{\partial \Phi(x, \lambda)}{\partial x_j} = 0, (j = \overline{1, n}) \\ \frac{\partial \Phi(x, \lambda)}{\partial \lambda_i} = g_i(x) = 0, (i = \overline{1, m}) \end{cases} \quad (7.5)$$

щодо змінних x і λ .

Метод Лагранжа складається з наступних етапів.

1. Складання функції Лагранжа $\Phi(x, \lambda)$.

2. Знаходження частинних похідних

$$\frac{\partial \Phi(x, \lambda)}{\partial x_j}, j = \overline{1, n} \quad \text{і} \quad \frac{\partial \Phi(x, \lambda)}{\partial \lambda_i}, i = \overline{1, m}.$$

3. Розв'язання системи рівнянь (7.5) щодо змінних x і λ .

4. Дослідження точок, що задовольняють системі (7.5), на максимум (мінімум) за допомогою достатньої ознаки екстремуму.

Наявність останнього (четвертого) етапу пояснюється тим, що розглянутий алгоритм виконує необхідну, але не достатню умову екстремуму. Для визначення достатніх ознак умовного екстремуму і його типу існує спеціальний алгоритм, як правило, важко застосовний на практиці.

Основне практичне значення методу Лагранжа полягає в тому, що він дозволяє перейти від умовної оптимізації до безумовної. Однак задача розв'язання системи рівнянь (7.5), до якої зводиться даний метод, у загальному випадку не простіше вихідної проблеми пошуку екстремуму (7.2)-(7.3). Методи, що припускають таке розв'язання, називаються *непрямими*. Їх можна застосовувати для досить вузького класу задач, для яких вдається одержати лінійну або таку, що зводиться до лінійної систему рівнянь (7.5). Їх застосування пояснюється необхідністю одержати розв'язок екстремальної задачі в аналітичній формі. При розв'язанні конкретних практичних задач зазвичай використовують *прямі* методи, засновані на ітеративних процесах обчислення й порівнянні значень функцій, що оптимізують.

7.3. Опукле програмування

Основний недолік методів нелінійного програмування полягає в тому, що з їх допомогою не вдається знайти глобальний екстремум при наявності кількох локальних екстремумів. Теоретично нелінійне програмування розроблене тільки для одного окремого випадку опуклих функцій, і відповідно цей розділ названий **опуклим програмуванням**.

Функцію $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$ називають **опуклою** в області D , якщо для будь-яких двох точок $x^{(1)}, x^{(2)} \in D$ і будь-якого $\lambda = \overline{0, 1}$ виконується нерівність

$$f((1-\lambda)x^{(1)} + \lambda x^{(2)}) \leq (1-\lambda)f(x^{(1)}) + \lambda f(x^{(2)}), \quad (7.6)$$

якщо

$$f((1-\lambda)x^{(1)} + \lambda x^{(2)}) \geq (1-\lambda)f(x^{(1)}) + \lambda f(x^{(2)}), \quad (7.7)$$

то функція називається **увігнутою**.

Геометричний зміст понять опуклості й увігнутості для функції однієї змінної представлений на рис. 7.2. З нього видно, що графік опуклої функції лежить нижче відрізка, що з'єднує точки $(x^{(1)}, f(x^{(1)}))$ і $(x^{(2)}, f(x^{(2)}))$, а графік увігнутої — вище.

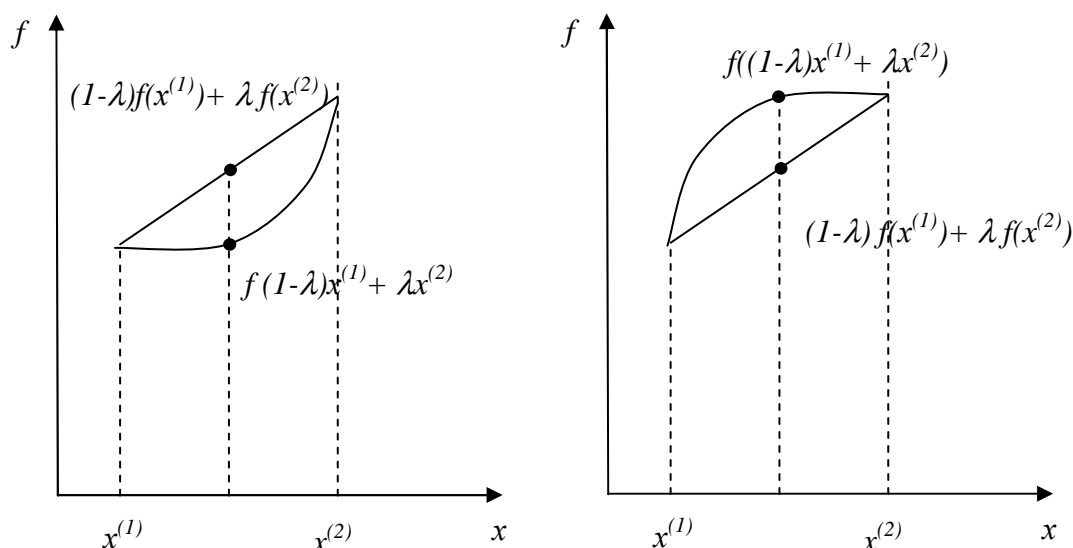


Рис. 7.2 – Графіки опуклої й увігнутої функцій

Можна довести, що *достатньою умовою опуклості* функції $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$ є *позитивна визначеність* матриці

$$H(x) = \left(\frac{\partial^2 f(x)}{\partial x_i \partial x_j} \right)_{n \times n}, \quad (7.8)$$

називаної *матрицею Гессе*, у всіх точках $x \in D$. Відповідно, *достатньою умовою увігнутості* є *негативна визначеність* матриці Гессе. Зокрема, для функцій однієї змінної достатньою умовою опуклості (увігнутості) є виконання нерівності $f''(x) \geq 0$ ($f''(x) \leq 0$).

Як видно з геометричної інтерпретації, для опуклої функції локальний екстремум, якщо він існує, збігається із глобальним. Для функції багатьох змінних точка x_0 являє собою вектор $f'(x)$ – вектор перших похідних (градієнт) функції $f(x)$, а матриця Гессе (гессіан) $f''(x)$ – симетричну матрицю других частинних похідних функції $f(x)$. Характер стаціонарної точки x_0 пов'язаний зі знаковизначеністю матриці Гессе $f''(x^*)$.

Знаковизначеність матриці A залежить від знаків квадратичної форми

$$Q(x) = X^T A X = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n a_{ij} x_i x_j. \quad (7.9)$$

Квадратична форма $Q(x)$ є позитивно визначеною (напіввизначеною), якщо значення всіх кутових мінорів визначника $|A|$ додатні (невід'ємні). У цьому випадку матрицю A називають позитивно визначеною (напіввизначеною). k -м кутовим мінором визначника матриці $A_{n \times n}$ називають визначник виду

$$\begin{vmatrix} a_{11} & a_{12} & \dots & a_{1k} \\ a_{21} & a_{22} & \dots & a_{2k} \\ \vdots & \vdots & \dots & \vdots \\ a_{k1} & a_{k2} & \dots & a_{kk} \end{vmatrix}, \quad k = \overline{1, n}. \quad (7.10)$$

Визначимо функцію Лагранжа:

$$\Phi(x, \lambda) = f(x_1, x_2, \dots, x_n) - \sum_{i=1}^m \lambda_i g_i(x_1, x_2, \dots, x_n). \quad (7.12)$$

Пару векторів (x, λ) називають *сідловою точкою* функції $\Phi(x, \lambda)$ у певній області, якщо для будь-яких x і λ , що належать цієї області,

$$\Phi(x, \lambda^*) \leq \Phi(x^*, \lambda^*) \leq \Phi(x^*, \lambda). \quad (7.13)$$

Нерівності (7.13) називають *нерівностями сідлової точки*.

Як приклад розглянемо функцію $\Phi(x, \lambda) = -x^2 + \lambda^2$. Сідловою точкою для цієї функції є точка $(0, 0)$. Справді, $\Phi(0, 0) = 0$, $\Phi(x, 0) = -x^2$, $\Phi(0, \lambda) = \lambda^2$, а для будь-яких x і λ виконуються нерівності $-x^2 \leq 0$ і $0 \leq \lambda^2$.

На рис. 7.3 зображений графік функції $\Phi(x, \lambda)$ (гіперболічний параболоїд), і, як видно, в оточенні точки $(0, 0)$ він дійсно за формою нагадує сідло, чим і пояснюється походження відповідного терміна.

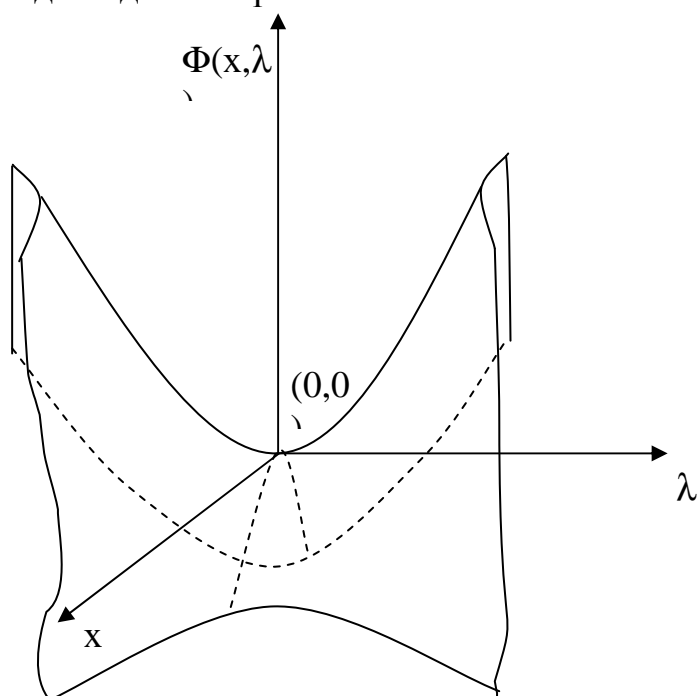


Рис. 7.3 – Графік функції $\Phi(x, \lambda)$

Центральне місце в теорії нелінійного програмування займає **теорема Куна-Таккера**, що пов'язує розв'язання ЗНП із наявністю сідлової точки у відповідній функції Лагранжа.

Теорема 7.1. (Достатня умова екстремуму).

Якщо (x^*, λ^*) — сідлова точка функції Лагранжа в області $x \in X \supseteq D$, $\lambda \geq 0$, то x^* є оптимальним планом задачі (7.11), причому справедливе так зване правило додаткової нетвердості (умова Слейтера):

$$\sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x^*) = 0. \quad (7.14)$$

Доказ.

Скористаємося визначенням сідлової точки й запишемо

$$f(x) - \sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x) \leq f(x^*) - \sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x^*) \leq f(x^*) - \sum_{i=1}^m \lambda_i g_i(x^*) \quad (7.15)$$

при всіх $x \in X$, $\lambda \geq 0$. Із другої нерівності в (7.15) випливає, що

$$\sum_{i=1}^m \lambda_i g_i(x^*) \leq \sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x^*) \text{ для } \lambda \geq 0. \quad (7.16)$$

Однак (7.16) може мати місце тільки тоді, коли $g(x^*) \leq 0$ при всіх $i = \overline{1, m}$. Дійсно, якщо існує таке k , що $g_k(x^*) > 0$, то поклавши $\lambda_i = 0$ для всіх $i \neq k$ і вибравши досить велике $\lambda_k > 0$, можна домогтися того, що значення $\sum_{i=1}^m \lambda_i g_i(x^*) = \lambda_k g_k(x^*)$ опиниться більшим за постійний вираз $\sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x^*)$.

З того, що для всіх $i = \overline{1, m}$ виконуються нерівності $g_i(x^*) \leq 0$, випливає, що x^* є припустимим планом задачі (7.11).

Якщо до лівої частини нерівності (7.16) підставити значення $\lambda_i = 0$ для всіх $i = \overline{1, m}$, одержимо

$$\sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x^*) \geq 0.$$

Разом з тим з того що, $g_i(x^*) \leq 0$ і $\lambda_i^* \geq 0$ випливає оцінка

$$\sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x^*) \leq 0.$$

Спільний розгляд останніх двох нерівностей приводить до правила додаткової нетвердості у точці x^* :

$$\sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x^*) = 0.$$

Тоді на підставі лівої частини нерівності сідлової точки (7.15) маємо, що для всіх $x \in X$ (у тому числі й для $x \in D$)

$$f(x^*) \geq f(x) - \sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x).$$

За умовою ЗНП для будь-яких $x \in D$ вірні нерівності $g_i(x^*) \leq 0$, що в сполученні з умовою $\lambda_i^* = 0$ дозволяє записати

$$\sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x) \leq 0.$$

Виходить,

$$f(x) - \sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(x) \geq f(x).$$

Остаточно одержуємо, що для будь-яких $x \in D$ справедливе співвідношення $f(x^*) \geq f(x)$, тобто x^* — оптимальний план задачі (7.11).

Значення теореми Куна-Таккера полягає в тому, що вона дозволяє зв'язати процес розв'язання оптимізаційної задачі з пошуком сідлових точок функції Лагранжа, тобто з максимізацією цієї функції за x і мінімізацією за λ .

Нехай $F(x)$ є функцією, що ставить у відповідність кожному значенню x мінімальне значення функції $\Phi(x, \lambda)$ по λ :

$$F(x) = \min_{\lambda \geq 0} \Phi(x, \lambda)$$

і за аналогією

$$G(\lambda) = \max_{x \in X} \Phi(x, \lambda).$$

Розглянемо задачу відшукування максимуму функції $F(x)$

$$F(x) = \min_{\lambda \geq 0} \Phi(x, \lambda) \rightarrow \max, \quad x \in X \quad (7.17)$$

і задачу мінімізації $G(\lambda)$

$$G(\lambda) = \max_{x \in X} \Phi(x, \lambda) \rightarrow \min, \quad \lambda \geq 0. \quad (7.18)$$

Очевидно, що

$$F(x) = \min_{\lambda \geq 0} \Phi(x, \lambda) = \begin{cases} f(x), & x \in D, \\ \infty, & x \notin D \end{cases}.$$

Звідси випливає, що максимум $F(x)$ перебуває в припустимій області D і збігається з максимумом цільової функції $f(x)$ задачі (7.11):

$$\max_{x \in X} F(x) = \max_{x \in X} \min_{\lambda \geq 0} \Phi(x, \lambda) = \max_{x \in D} f(x).$$

Отже, задача (7.17), у певному змісті, рівносильна (7.11). Аналогічні висновки можна отримати і для (7.18). Задачі (7.17) і (7.18) утворюють двоїсту пару. Це відношення є узагальненням відношення подвійності для задач лінійного програмування. Відповідно, за певних умов пара двоїстих задач нелінійного програмування має властивості, аналогічні властивостям двоїстих лінійних задач. Зокрема, при будь-яких $x \in X, \lambda \geq 0$

$$F(x) \leq G(\lambda). \quad (7.19)$$

Умова (7.19) знаходить широке застосування при побудові оцінок в ітеративних методах розв'язання оптимізаційних задач. Наприклад, якщо є можливість приблизно вирішити пряму й двоїсту задачі й одержати послідовності наближень, то за допомогою нерівностей виду

$$f(x^{(k)}) \leq f(x^*) \leq G(\lambda^{(k)})$$

можна визначити момент зупинки обчислювальної процедури.

Можливим є варіант виведення виразів для цільових функцій і обмежень пари двоїстих задач лінійного програмування із загального визначення відносини подвійності для нелінійних задач. Також відзначимо, що в процесі формування нелінійних двоїстих задач існує велика неоднозначність: їх вид можна варіювати, включаючи до множини X частину обмежень $g_i(x) \leq 0$.

7.5. Деякі методи розв'язання задач НЛП

7.5.1. Градієнтні методи розв'язання задач безумовної оптимізації.

Провідне місце серед прямих методів розв'язання екстремальних задач займає *градієнтний метод* (точніше, сімейство градієнтних методів) пошуку стаціонарних точок диференційованої функції. Нагадаємо, що *стаціонарною* називають точку, у якій $\nabla f(x)=0$ і яка відповідно до необхідної умови оптимальності є «підозрілою» на наявність локального екстремуму. Отже, застосовуючи градієнтний метод, знаходять множину точок локальних максимумів (або мінімумів), серед яких визначають максимум (або мінімум) глобальний.

Ідея цього методу заснована на тому, що градієнт функції вказує напрямок її *найшвидшого зростання* в оточенні тієї точки, в якій він обчислений. Тому, якщо з деякої поточної точки $x^{(1)}$ переміщатися в напрямку вектора $\nabla f(x^{(1)})$, функція f зростатиме, принаймні, у певному оточенні $x^{(1)}$. Отже, для точки $x^{(2)} = x^{(1)} + k \nabla f(x^{(1)})$, ($k > 0$), що лежить у такому оточенні, справедлива нерівність $f(x^{(1)}) \leq f(x^{(2)})$. Продовжуючи цей процес, ми поступово будемо наближатися до точки деякого локального максимуму.

Однак як тільки визначається напрямок руху, відразу встає питання, як далеко треба рухатися в цьому напрямку, тобто виникає проблема вибору кроку r у рекурентній формулі

$$x^{(k+1)} = x^{(k)} + r \nabla f(x^{(k)}), \quad (7.20)$$

що задає послідовність точок, які прагнуть до точки максимуму.

Залежно від способу її розв'язання розрізняють різні варіанти градієнтного методу. Зупинимось на найвідоміших з них.

Метод найшвидшого спуска. Назву методу можна було б розуміти буквально, якби мова йшла про мінімізацію цільової функції. Проте, за традицією таку назву використовують і при розв'язанні задач на максимум.

Нехай $f(x) = f(x_1, x_2, \dots, x_n)$ — диференційована функція, а $x^{(k)} = (x_1^{(k)}, x_2^{(k)}, \dots, x_n^{(k)})$ — певна поточна точка. Будь-яких загальних рекомендацій, щодо вибору вихідної точки (початкового наближення) $x^{(0)}$ не існує, але за можливістю вона повинна перебувати близько від шуканого оптимального плану x^* . Якщо $x^{(k)}$ — нестаціонарна точка, то при русі в напрямку $\nabla f(x^{(k)})$ функція $f(x)$ на певному проміжку обов'язково зростатиме. Звідси виникає необхідність такого вибору кроку, щоб рух у зазначеному напрямку тривало доти, поки зростання не припиниться. Виразимо залежність значення $f(x)$ від крокового множника $r > 0$, покладаючи $x = x^{(k)} + r \nabla f(x^{(k)})$

$$f(x) = f(x^{(k)} + r \nabla f(x^{(k)})) = \varphi(r), \quad (7.21)$$

або в координатній формі,

$$\varphi(r) = f\left(x_1^{(k)} + r \frac{\partial f(x^{(k)})}{\partial x_1}, \dots, x_n^{(k)} + r \frac{\partial f(x^{(k)})}{\partial x_n}\right). \quad (7.22)$$

Щоб домогтися найбільшого з можливих значень f при русі у напрямку $\nabla f(x^{(k)})$, потрібно вибрати таке значення r , що максимізує функцію $\varphi(r)$. Для обчислення r використовують необхідну умову екстремуму $\frac{d\varphi(r)}{dr} = 0$. Помітимо,

що якщо для будь-якого $r > 0$ $\frac{d\varphi(r)}{dr} > 0$, то функція $f(x)$ не обмежена зверху (тобто не має максимуму). У протилежному випадку, на підставі (7.22) одержуємо

$$\frac{d\varphi(r)}{dr} = \frac{\partial f(x)}{\partial x_1} \times \frac{dx_1}{dr} + \dots + \frac{\partial f(x)}{\partial x_n} \times \frac{dx_n}{dr}, \quad (7.23)$$

що, у свою чергу, дає

$$\frac{d\varphi(r)}{dr} = \frac{\partial f(x)}{\partial x_1} \times \frac{\partial f(x^{(k)})}{\partial x_1} + \dots + \frac{\partial f(x)}{\partial x_n} \times \frac{\partial f(x^{(k)})}{\partial x_n} = \nabla f(x) \nabla f(x^{(k)}). \quad (7.24)$$

Якщо вважати, що наступна точка $x^{(k+1)}$ відповідає оптимальному значенню, то в ній повинна виконуватися умова $\frac{d\varphi(r)}{dr} = 0$, і r треба знаходити з умови $\nabla f(x^{(k+1)}) \nabla f(x^{(k)}) = 0$ або

$$\nabla f(x^{(k)} + r \nabla f(x^{(k)})) \nabla f(x^{(k)}) = 0. \quad (7.25)$$

Умова (7.25) означає рівність нулю скалярного добутку градієнтів функції f в точках $x^{(k+1)}$ і $x^{(k)}$. Геометрично її можна інтерпретувати як перпендикулярність векторів градієнтів функції f у зазначених точках. Продовжуючи геометричну інтерпретацію методу найскорішого спуска, відзначимо, що в точці $x^{(k+1)}$ вектор $\nabla f(x^{(k+1)})$, будучи градієнтом, перпендикулярний до лінії рівня, що проходить через цю точку. Відповідно вектор $\nabla f(x^{(k)})$ є дотичним до цієї лінії. Отже, рух у напрямку градієнта $\nabla f(x^{(k)})$ треба продовжувати доти, поки він перетинає лінії рівня функції, що оптимізують.

Після того як точку $x^{(k+1)}$ знайдено, вона стає поточною для чергової ітерації. На практиці ознакою досягнення стаціонарної точки служить досить мала зміна координат точок, розглянутих на послідовних ітераціях. Одночасно із цим координати вектора $\nabla f(x^{(k)})$ повинні наближатись до нуля.

Метод дроблення кроку. Для знаходження кроку r у методі найскорішого спуска потрібно вирішити рівняння (7.25), що може виявитися досить складним. Тому часто обмежуються «підбором» такого значення r , що $\varphi(r) > \varphi(0)$. Для цього задаються деяким початковим значенням r_1 (наприклад, $r_1=1$) і перевіряють умову $\varphi(r_1) > \varphi(0)$. Якщо вона не виконується, то покладають

$$r_2 = \frac{r_1}{2}$$

і т.д. доти, поки не вдається знайти підходящий крок, з яким переходять до наступної точки $x^{(k+1)}$. Критерій завершення алгоритму буде таким самим, як і в методі найскорішого спуска.

7.5.2. Квадратичне програмування (КП)

До задач квадратичного програмування належить спеціальний клас задач нелінійного програмування, для яких цільова функція $f(x)$ квадратична, а всі обмеження - лінійні. Застосувавши до цієї задачі теорему Куна-Таккера, одержують умову для оптимального розв'язку у вигляді системи лінійних рівнянь, вирішити які можна за симплекс-методом. У матричному виді задачу квадратичного програмування формулюють в такий спосіб:

Максимізувати (мінімізувати) цільову функцію $f = \overline{C}\overline{X} + \overline{X}^T \overline{D}\overline{X}$ при обмеженнях

$$\overline{A}\overline{X} \leq b, \quad \overline{X} \geq 0, \quad (7.26)$$

де

$$\overline{X} = (x_1, x_2, \dots, x_n)^T,$$

$$\overline{C} = (c_1, c_2, \dots, c_n),$$

$$b = (b_1, b_2, \dots, b_m)^T,$$

$$\overline{A} = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \dots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \dots & a_{2n} \\ \vdots & \vdots & \dots & \vdots \\ a_{m1} & a_{m2} & \dots & a_{mn} \end{pmatrix},$$

$$\overline{D} = \begin{pmatrix} d_{11} & d_{12} & \dots & d_{1n} \\ d_{21} & d_{22} & \dots & d_{2n} \\ \vdots & \vdots & \dots & \vdots \\ d_{n1} & d_{n2} & \dots & d_{nn} \end{pmatrix}.$$

Функція $\overline{X}^T \overline{D}\overline{X}$, де D – симетрична матриця, що є квадратичною формою (7.9). Матриця D є негативно визначеною в задачі максимізації й позитивно визначеною – у задачі мінімізації. Це означає, що функція f є строго опуклою за змінними \overline{X} у задачі мінімізації й строго ввігнутою – у задачі максимізації. Обмеження задачі є лінійними, що гарантує опуклість області припустимих розв'язків.

Складемо функцію Лагранжа для задачі (7.26)

$$\Phi(\overline{X}, \overline{\lambda}) = \overline{C}\overline{X} + \overline{X}^T \overline{D}\overline{X} + \overline{\lambda}(b - \overline{A}\overline{X}) \quad (7.27)$$

Відповідно до теореми Куна-Таккера для існування сідлової точки необхідно й достатньо, щоб похідні функції Лагранжа за x_j були менше нуля, а за λ_i – більше нуля, маємо:

$$\frac{\partial \Phi(\overline{X}, \overline{\lambda})}{\partial x_j} = \overline{C} + 2\overline{D}\overline{X} - \overline{\lambda}\overline{A} \leq 0, \quad (7.28)$$

причому, якщо $\frac{\partial \Phi}{\partial x_j} < 0$, відповідні x_j дорівнюють нулю;

$$\frac{\partial \Phi(\bar{X}, \bar{\lambda})}{\partial \lambda_i} = b - \bar{A}\bar{X} \geq 0, \quad (7.29)$$

якщо $\frac{\partial \Phi}{\partial \lambda_i} > 0$, відповідні λ_i дорівнюють нулю.

Щоб нерівності (7.28) і (7.29) привести до рівностей, введемо два допоміжних вектори: $\bar{V} = (v_1, v_2, \dots, v_n) \geq 0$ і $\bar{S} = (s_1, s_2, \dots, s_m) \geq 0$, причому виберемо $v_j > 0$, якщо $\frac{\partial \Phi}{\partial x_j} < 0$ й $v_j = 0$, якщо $\frac{\partial \Phi}{\partial x_j} = 0$, а також $\lambda_i > 0$, якщо $\frac{\partial \Phi}{\partial \lambda_i} > 0$ й $\lambda_i = 0$, якщо $\frac{\partial \Phi}{\partial \lambda_i} = 0$, одержимо

$$\bar{C} + 2\bar{D}\bar{X} - \bar{\lambda}\bar{A} + \bar{V} = 0 \quad (7.30)$$

$$b - \bar{A}\bar{X} - \bar{S} = 0 \quad (7.31)$$

Порівнявши компоненти векторів \bar{X} і \bar{V} , а також $\bar{\lambda}$ і \bar{S} , одержимо дві умови додаткової нетвердості

$$\bar{X}^T \bar{V} = 0 \text{ і } \bar{\lambda}^T \bar{S} = 0 \quad (7.32)$$

З умов (7.32) випливає, що хоча n змінних з \bar{X} і \bar{V} , а також m змінних з $\bar{\lambda}$ і \bar{S} звертаються на нуль. Якщо існує оптимальний розв'язок задачі (7.26), то він є одним з базисних розв'язків системи (7.30), (7.31). Для знаходження припустимого базисного розв'язку використовується симплекс-метод.

Розглянемо приклад. Знайти

$$\max f(x_1, x_2) = \max(10x_1 + 20x_2 + x_1x_2 - 2x_1^2 - 2x_2^2)$$

при обмеженнях:

$$\begin{aligned} 8 - x_2 &\geq 0; \\ 10 - x_1 - x_2 &\geq 0; \\ x_1 &\geq 0; \quad x_2 &\geq 0. \end{aligned}$$

Можна показати, що функція $f(x_1, x_2)$ є увігнутою функцією. Складемо функцію Лагранжа

$$\Phi(x_1, x_2, \lambda_1, \lambda_2) = 10x_1 + 20x_2 + x_1x_2 - 2x_1^2 - 2x_2^2 + \lambda_1(8 - x_2) + \lambda_2(10 - x_1 - x_2).$$

Застосувавши теорему Куна-Таккера, одержимо умови існування сідлової точки:

$$\begin{aligned} \frac{\partial \Phi}{\partial x_1} &= 10 + x_2 - 4x_1 + \lambda_2 \leq 0 \\ \frac{\partial \Phi}{\partial x_2} &= 20 + x_1 - 4x_2 - \lambda_1 - \lambda_2 \leq 0 \\ \frac{\partial \Phi}{\partial \lambda_1} &= 8 - x_2 \geq 0 \\ \frac{\partial \Phi}{\partial \lambda_2} &= 10 - x_1 - x_2 \geq 0 \end{aligned} \quad .$$

Одержали систему лінійних нерівностей:

$$\begin{cases} 10 + x_2 - 4x_1 + \lambda_2 \leq 0 \\ 20 + x_1 - 4x_2 - \lambda_1 - \lambda_2 \leq 0 \\ 8 - x_2 \geq 0 \\ 10 - x_1 - x_2 \geq 0 \end{cases}.$$

Введемо вільні змінні \bar{V} й \bar{S} , що обертають систему нерівностей на систему лінійних рівнянь, вирішивши яку за симплекс-методом, знайдемо оптимум

$$\begin{cases} 4x_1 - x_2 - \lambda_2 - v_1 = 10 \\ -x_1 + 4x_2 + \lambda_1 + \lambda_2 - v_2 = 20 \\ x_2 + s_1 = 8 \\ x_1 + x_2 + s_2 = 10 \end{cases}.$$

Для знаходження припустимого базисного плану отриманої задачі скористаємося методом мінімізації нев'язань. Для цього побудуємо допоміжну задачу, увівши до обмежень 1 і 2 фіктивні змінні x_3 і x_4 , які входять до цільової функції допоміжної задачі з коефіцієнтами M (а інші змінні – з нульовими коефіцієнтами). Отже, допоміжна задача має вигляд

$$\begin{aligned} f'(x) &= Mx_3 + Mx_4, \\ \begin{cases} 4x_1 - x_2 - \lambda_2 - v_1 + x_3 = 10 \\ -x_1 + 4x_2 + \lambda_1 + \lambda_2 - v_2 + x_4 = 20 \\ x_2 + s_1 = 8 \\ x_1 + x_2 + s_2 = 10 \end{cases} \end{aligned}.$$

Складемо симплекс-таблицю

Базис	$C_{\text{баз}}$	C_j	0	0	0	0	0	0	0	M	M	0	0
		B	A_1	A_2	A_3	A_4	A_5	A_6	A_7	A_8	A_9	A_{10}	
A_7	M	10	4	-1	0	-1	-1	0	1	0	0	0	0
A_8	M	20	-1	4	1	1	0	-1	0	1	0	0	0
A_9	0	8	0	1	0	0	0	0	0	0	1	0	0
A_{10}	0	10	1	1	0	0	0	0	0	0	0	0	1
L_j		30M	3M	3M	M	0	-M	-M	M	M	0	0	0
Δ_i			3M	3M	M	0	-M	-M	0	0	0	0	0

Оскільки в першу чергу необхідно мінімізувати нев'язання, виведемо з базису вектор \bar{A}_7 і введемо вектор \bar{A}_1 (тим самим змінна x_3 рівнюватиме нулю, а змінна x_1 увійде до базису). Складемо нову симплекс-таблицю.

Базис	$C_{\text{баз}}$	C_j	0	0	0	0	0	0	M	M	0	0
		B	A_1	A_2	A_3	A_4	A_5	A_6	A_7	A_8	A_9	A_{10}
A_1	0	10/4	1	-1/4	0	-1/4	-1/4	0	1/4	0	0	0
A_8	M	90/4	0	15/4	1	3/4	-1/4	-1	1/4	1	0	0
A_9	0	8	0	1	0	0	0	0	0	0	1	0
A_{10}	0	30/4	0	5/4	0	1/4	1/4	0	-1/4	0	0	1
L_j		90M/4	0	15M/4	M	3M/4	-M/4	-M	M/4	M	0	0
Δ_j			0	15M/4	M	3M/4	-M/4	-M	3M/4	0	0	0

Тепер виведемо з базису вектор \bar{A}_8 і введемо \bar{A}_2

Базис	$C_{\text{баз}}$	C_j	0	0	0	0	0	0	M	M	0	0
		B	A_1	A_2	A_3	A_4	A_5	A_6	A_7	A_8	A_9	A_{10}
A_1	0	4	1	0	1/15	-1/5	-4/15	-1/15	4/15	1/15	0	0
A_2	0	6	0	1	4/15	3/15	-1/15	-4/15	1/15	4/15	0	0
A_9	0	2	0	0	-4/15	-1/5	1/15	4/15	-1/15	-4/15	1	0
A_{10}	0	0	0	0	-1/3	0	1/3	1/3	-1/3	-1/3	0	1
L_j		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Δ_j		0	0	0	0	0	0	0	-M	-M	0	0

Дістали припустимий базисний план вихідної задачі:

$$x_1=4; x_2=6; \lambda_1=0; \lambda_2=0; v_1=0; v_2=0; s_1=2; s_2=0.$$

Перевіримо виконання умов правила додаткової нетвердості (7.32)

$$\bar{X}^T \bar{V} = 0 \text{ і } \bar{\lambda}^T \bar{S} = 0:$$

$$x_1 * v_1 = 0; x_2 * v_2 = 0; \lambda_1 * s_1 = 0; \lambda_2 * s_2 = 0.$$

Оскільки умови додаткової нетвердості виконуються, отриманий план є оптимальним. Оптимальне значення цільової функції

$$f(x_1, x_2) = 10*4 + 20*6 + 4*6 - 2*4^2 - 2*6^2 = 80.$$

Контрольні запитання

1. За яких умов оптимізаційну задачу можна віднести до класу нелінійних?
2. Наведіть приклад економічної моделі, що зводиться до задачі нелінійного програмування.
3. Перелічіть основні труднощі, що виникають у процесі розв'язання задачі нелінійного програмування.
4. Який зміст вкладають в поняття «умовна оптимізація»?
5. Для чого призначений метод множників Лагранжа й у чому він полягає?
6. Яку точку множини розв'язків називають стаціонарною?
7. Які принципові етапи входять у градієнтні методи?
8. Для розв'язання яких задач призначений метод найскорішого спуску й метод дроблення кроку?
9. Дайте визначення опуклої (увігнутої) функції.
10. Сформулюйте достатню умову опуклості (увігнутості) функції.
11. У чому полягає специфіка задач опуклого програмування?
12. Дайте визначення сідлової точки. Наведіть приклад функції, що має сідлову точку.
13. Сформулюйте необхідну й достатню умови теореми Куна-Таккера. Яке значення вони мають для розв'язання задач нелінійного програмування?
14. У чому полягає умова регулярності Слейтера? Поясніть її зміст.
15. Наведіть приклад пари двоїстих задач нелінійного програмування.
16. Які властивості пари нелінійних двоїстих задач можна застосувати для їх розв'язання?

ТЕМА 8. ДИНАМІЧНЕ ПРОГРАМУВАННЯ

8.1. Загальна схема методів динамічного програмування

Деякі задачі математичного програмування мають специфічні особливості, які дозволяють звести їх розв'язання до розгляду ряду простіших підзадач. В результаті глобальна оптимізація деякої функції зводиться до поетапної оптимізації проміжних цільових функцій. У динамічному програмуванні розглядають методи, що дозволяють шляхом поетапної (багатокрокової) оптимізації одержати загальний (результуючий) оптимум.

За методами динамічного програмування оптимізують роботу керованих систем, ефективність яких оцінюється адитивною, або мультиплікативною, цільовою функцією. Адитивною називають таку функцію кількох змінних $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$, значення якої обчислюється як сума функцій f_j , що залежать тільки від однієї змінної x_j :

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) = \sum_{j=1}^n f_j(x_j) \quad (8.1)$$

Доданки адитивної цільової функції відповідають ефективності розв'язків, прийнятих на окремих етапах керованого процесу. За аналогією, мультиплікативна функція розпадається на добуток позитивних функцій різних змінних:

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) = \prod_{j=1}^n f_j(x_j). \quad (8.2)$$

Оскільки логарифм функції (8.2) є адитивною функцією, обмежимося розглядом функцій виду (8.1).

Обчислення в динамічному програмуванні виконують рекурентно (рекурентний означає поворотний), так що оптимальне розв'язання однієї підзадачі використовують як вихідні дані для наступної. Вирішивши останню підзадачу, одержують оптимальний розв'язок вихідної задачі - глобальний оптимум.

Розглянемо приклад. Нехай необхідно вибрати найкоротший шлях між двома містами. Сітка доріг (рис. 8.1) утворює можливі маршрути між вихідним містом, що перебуває у вузлі 1, і кінцевим пунктом, що перебуває у вузлі 7. Маршрути проходять через проміжні міста, позначені вузлами з номерами 2-6.

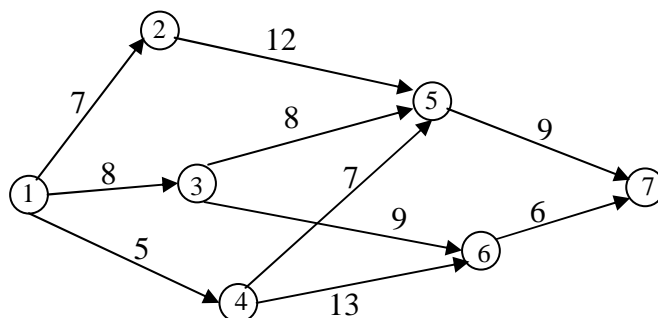


Рис. 8.1 – Сітка доріг, що утворює можливі маршрути

Цю задачу можна вирішити шляхом перебору всіх маршрутів між вузлами 1 і 7. Однак у великій сітці такий підхід є неефективним. Для розв'язання задачі за методом динамічного програмування розділимо її на три етапи (рис. 8.2) і виконаємо обчислення для кожного етапу окремо.

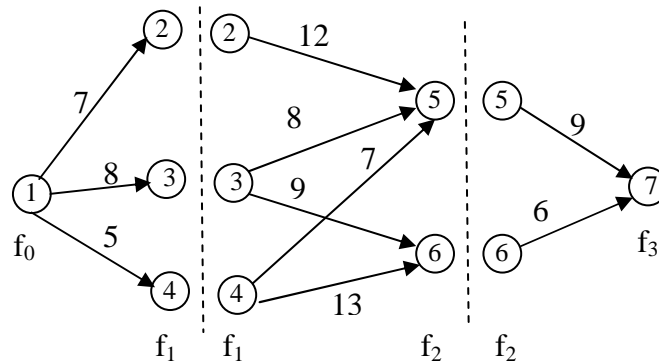


Рис. 8.2 – Декомпозиція задачі

Обчислимо найкоротші відстані до всіх вузлів першого етапу з наступним використанням цих відстаней як вихідних даних для другого етапу. На першому етапі кожний з вузлів 2, 3 і 4 пов'язаний з початковим вузлом 1 єдиною дугою, маємо

найкоротший шлях (1-2) дорівнює $f_1=7$ км;

найкоротший шлях (1-3) дорівнює $f_1=8$ км;

найкоротший шлях (1-4) дорівнює $f_1=5$ км.

На другому етапі обчислимо найкоротші відстані до вузлів 5 і 6. Розглянемо вузол 5. До нього ведуть три маршрути (2, 5), (3, 5) і (4, 5). Найкоротша відстань до вузла 5 з урахуванням відстаней до вузлів 2, 3 і 4 визначиться в такий спосіб

$$f_2 = \min_{i=2,3,4} \left\{ f_1 + \text{відстань від} \right\} = \min \begin{pmatrix} 7 + 12 = 19 \\ 8 + 8 = 16 \\ 5 + 7 = 12 \end{pmatrix} = 12 \text{ (з вузла 4)}.$$

Аналогічно для вузла 6 одержимо

$$f_2 = \min_{i=2,3,4} \left\{ f_1 + \text{відстань від} \right\} = \min \begin{pmatrix} 8 + 9 = 17 \\ 5 + 13 = 18 \end{pmatrix} = 17 \text{ (з вузла 3)}.$$

Звернемося до третього етапу. Кінцевий вузол 7 можна досягти як з вузла 5 так і з вузла 6. Використовуючи результати другого етапу, одержимо

$$f_3 = \min_{i=5,6} \left\{ f_2 + \text{відстань від} \right\} = \min \begin{pmatrix} 12 + 9 = 21 \\ 17 + 6 = 23 \end{pmatrix} = 21 \text{ (з вузла 5)}.$$

Остаточню, найкоротший шлях до вузла 7 становить 21 км, оптимальний маршрут - послідовність вузлів 1, 4, 5, 7.

Рекурентні обчислення динамічного програмування виражають математично в такий спосіб. Нехай $f_i(x_i)$ – найкоротша відстань до вузла x_i на етапі i , $d(x_{i-1}, x_i)$ – відстань від вузла x_{i-1} до вузла x_i , тоді f_i обчислюється на підставі рекурентного виразу

$$f_i(x_i) = \min \{ d(x_{i-1}, x_i) + f_{i-1}(x_{i-1}) \}, \quad i = \overline{1, n}. \quad (8.1)$$

Рівняння (8.1) показує, що функція цілі $f_i(x_i)$ на i -му етапі повинна бути вираженою як функція попереднього етапу. У термінології динамічного програмування x_i називають **станом системи** на етапі i . Стан системи на етапі i – це інформація, що пов'язує етапи між собою, при цьому оптимальні розв'язки для етапів, що залишилися, можуть прийматися без повторної перевірки того, як були отримані розв'язки на попередніх етапах. Таке визначення стану системи дозволяє розглядати кожний етап окремо й гарантує, що розв'язок є припустимим на кожному етапі. Отже, можна сформулювати **принцип оптимальності**:

На кожному етапі оптимальна стратегія визначається незалежно від стратегій, використаних на попередніх етапах. (Оптимальна стратегія керування не залежить від передісторії системи, а залежить від стану системи в поточний момент часу й цілі керування).

Послідовність обчислень, використана в прикладі, називається **алгоритмом прямого прогону**. Цю саму задачу можна вирішити за допомогою **алгоритму зворотного прогону**, за яким обчислення проводять від третього етапу до першого. Алгоритми прямого й зворотного прогону приведуть до того самого результату, але на практиці частіше використовують алгоритм зворотного прогону, оскільки він ефективніше з обчислювальної точки зору.

Для алгоритму зворотного прогону рекурентне рівняння (8.1) має вигляд

$$f_i(x_i) = \min\{d(x_i, x_{i+1}) + f_{i+1}(x_{i+1})\}, \quad i = \overline{1, n}, \quad (8.2)$$

Вирішимо задачу за алгоритмом зворотного прогону.

Етап 3. Вузол 7 пов'язаний з вузлами 5 і 6 тільки одним маршрутом. Результати третього етапу занесемо в таблицю

	$d(x_3, x_4)$	Оптимальний розв'язок	
x_3	$x_4=7$	$f_3(x_3)$	x^*_4
5	9	9	7
6	6	6	7

Етап 2. Використовуючи значення $f_3(x_3)$, отримані на третьому етапі, порівняємо припустимі альтернативні розв'язки в наступній таблиці

	$d(x_2, x_3) + f_3(x_3)$		Оптимальний розв'язок	
x_2	$x_3=5$	$x_3=6$	$f_2(x_2)$	x^*_3
2	$12+9=21$	-	21	5
3	$8+9=17$	$9+6=15$	15	6
4	$7+9=16$	$13+6=19$	16	5

Оптимальний розв'язок другого етапу означає, що з вузла 2 або 4 найкоротший шлях до вузла 7 проходить через вузол 5, а з вузла 3 – через вузол 6.

Етап 1. Використовуючи значення $f_2(x_2)$, отримані на другому етапі, порівняємо припустимі альтернативні розв'язки в наступній таблиці

	$d(x_2, x_3) + f_3(x_3)$			Оптимальний розв'язок	
x_1	$x_2=2$	$x_2=3$	$x_2=4$	$f_1(x_1)$	x^*_2
1	$7+21=28$	$8+15=23$	$5+16=21$	21	4

8.2. Основні типи задач і моделі динамічного програмування

Задача про завантаження. Це задача про раціональне завантаження судна, що має обмеження за обсягом або вантажопідйомністю. Кожний розміщений на судні вантаж приносить певний прибуток. Задача полягає у визначенні завантаження судна такими вантажами, які принесуть найбільший сумарний прибуток. Ця задача відома також як *задача про ранець*, в якій треба визначити найцінніші предмети, що підлягають завантаженню в ранець.

Нехай вантажопідйомність судна W предметів n найменувань, m_i – кількість предметів i -го найменування, що підлягають завантаженню, r_i – прибуток, що приносить один завантажений предмет i -го найменування, w_i – вага одного предмета i -го найменування. Формулювання задачі має вигляд:

Максимізувати $f = r_1 m_1 + r_2 m_2 + \dots + r_n m_n$
за умови

$$w_1 m_1 + w_2 m_2 + \dots + w_n m_n \leq W;$$

$$m_1, m_2, \dots, m_n \geq 0 \text{ і цілі.}$$

Елементи моделі динамічного програмування визначають в такий спосіб. Етап i ставиться у відповідність предмету i -го найменування; варіанти розв'язку на етапі i описують кількістю m_i предметів i -го найменування, що підлягають завантаженню. Відповідний прибуток дорівнює $r_i m_i$. Значення m_i ле-

жить у межах від 0 до $\frac{W}{w_i}$. Стан x_i на етапі i виражає сумарну вагу предметів, рішення про завантаження яких прийняті на етапах i .

Рекурентне рівняння має вигляд

$$f_i(x_i) = \max \{r_i m_i + f_{i+1}(x_i - w_i m_i)\}, \quad i = \overline{1, n} \quad (8.3)$$

Задача про завантаження є типовим представником задачі розподілу ресурсів, у якій обмежений ресурс розподіляють між кінцевим числом видів економічної діяльності. При цьому ціллю є максимізація прибутку. В таких моделях станом на етапі i є сумарна кількість ресурсу, що розподіляється на відповідному етапі.

Розглянемо приклад. В 4-тонне судно завантажують предмети трьох найменувань. Дані про вагу одного предмета й прибутку, одержуваного від одного завантаженого предмета, наведені в таблиці

Предмет i	w_i	r_i
1	2	31
2	3	47
3	1	14

Етап 3. Вага, що може бути завантаженою на етапі 3 (предмет 3) може приймати одне із значень 0, 1, 2, 3, 4 (оскільки вантажопідйомність судна 4 тонни). Основою для порівняння варіантів на даному етапі є співвідношення

$$f_3(x_3) = \max\{14m_3\}, \quad \max\{m_3\} = \frac{4}{1} = 4.$$

Припустимі розв'язки для кожного значення x_3 порівняємо в таблиці

	14 m_3					Оптимальний розв'язок	
x_3	$m_3=0$	$m_3=1$	$m_3=2$	$m_3=3$	$m_3=4$	$f_3(x_3)$	m^*_3
0	0	-	-	-	-	0	0
1	0	14	-	-	-	14	1
2	0	14	28	-	-	28	2
3	0	14	28	42	-	42	3
4	0	14	28	42	56	56	4

Етап 2. $f_2(x_2) = \max\{47m_2 + f_3(x_2 - 3m_2)\}, \quad \max\{m_2\} = \frac{4}{3} = 1$

	47 $m_2 + f_3(x_2 - 3m_2)$		Оптимальний розв'язок	
x_2	$m_2=0$	$m_2=1$	$f_2(x_2)$	m^*_2
0	0+0=0	-	0	0
1	0+14=14	-	14	0
2	0+28=28	-	28	0
3	0+42=42	47+0=47	47	1
4	0+56=56	47+14=61	61	1

Етап 1. $f_1(x_1) = \max\{31m_1 + f_2(x_1 - 2m_1)\}, \quad \max\{m_1\} = \frac{4}{2} = 2.$

	31 $m_1 + f_2(x_1 - 2m_1)$			Оптимальний розв'язок	
x_1	$m_1=0$	$m_1=1$	$m_1=2$	$f_1(x_1)$	m^*_1
0	0+0=0	-	-	0	0
1	0+14=14	-	-	14	0
2	0+28=28	31+0=31	-	31	1
3	0+47=47	31+14=45	-	47	0
4	0+61=61	31+28=59	62+0=62	62	2

З умови $W=4$ випливає, що перший етап при $x_1=4$ дає оптимальний розв'язок, що означає, що будуть завантажені два предмети першого найменування. Це завантаження залишає для предмета другого найменування $x_2 = x_1 - 2m^*_1 = 4 - 2 \cdot 2 = 0$. Розв'язання на другому етапі при $x_2=0$ приводить до оптимального розв'язку $m^*_2=0$, що дає $x_3 = x_2 - 3m^*_2 = 0 + 3 \cdot 0 = 0$. Далі етап 3 при $x_3=0$ приводить до $m^*_3=0$. Отже, оптимальним розв'язком задачі є $m^*_1=2$, $m^*_2=0$ і $m^*_3=0$. Відповідний прибуток становитиме 62 грошові одиниці.

Задача планування робочої сили. При виконанні певних проектів число робітників, необхідне для реалізації будь-якого проекту, регулюють шляхом їх наймання й звільнення. Наймання й звільнення робітників пов'язане з додатковими витратами. Треба визначити, як треба регулювати чисельність робітників.

Припустимо, що проект буде виконуватися протягом n тижнів і мінімальна потреба в робочій силі протягом i -го тижня складе b_i робітників. Однак залежно від вартісних показників може бути вигіднішим відхилення чисельності робітників як в одну так і в іншу сторону від мінімальної потреби. Якщо x_i - кількість робітників протягом i -го тижня, то можливі витрати двох видів: $C_1(x_i - b_i)$ - витрати пов'язані з необхідністю утримувати надлишок $x_i - b_i$ робочої сили й $C_2(x_i - x_{i-1})$ - витрати, пов'язані з необхідністю додаткового наймання $x_i - x_{i-1}$ робітників.

Елементи моделі динамічного програмування в цій задачі визначають в такий спосіб. Етап i представляють порядковим номером тижня i , $i = \overline{1, n}$. Варіантами розв'язку на i -му етапі є значення x_i - кількість робітників протягом i -го тижня. Станом на i -му етапі є x_{i-1} - кількість робітників протягом $(i-1)$ -го тижня (етапу).

Рекурентне рівняння динамічного програмування має вигляд

$$f_i(x_{i-1}) = \min \{C_1(x_i - b_i) + C_2(x_i - x_{i-1}) + f_{i+1}(x_i)\}, \quad i = \overline{1, n}, \quad (8.4)$$

Обчислення починають з етапу n при $x_n = b_n$ і закінчують на етапі 1.

Задача заміни устаткування. Чим довше механізм експлуатують, тим вище витрати на його обслуговування й нижче його продуктивність. Коли строк експлуатації механізму досягає певного рівня, може виявитися вигіднішою його заміна. Задача заміни устаткування зводиться до визначення оптимального строку експлуатації механізму.

Нехай на початку кожного року приймають рішення або про експлуатацію механізму ще один рік, або про заміну його новим. Позначимо $r(t)$ і $c(t)$ прибуток від експлуатації t -літнього механізму й витрати на його обслуговування протягом року. Нехай $s(t)$ - вартість продажу механізму, що експлуатувався t років. Вартість придбання нового механізму залишається незмінною протягом всіх n років і дорівнює I .

Елементи моделі динамічного програмування визначають в такий спосіб. Етап i представляють порядковим номером року i , $i = \overline{1, n}$. Варіантами розв'язку на i -му етапі є альтернативи: продовжити експлуатацію або замінити

механізм на початку i -го року. Станом на i -му етапі є тривалість експлуатації t механізму до початку i -го року.

Нехай $f_i(t)$ – максимальний прибуток, одержуваний за роки від i до n за умови, що на початку i -го року є механізм t -літнього віку.

Рекурентне рівняння має такий вигляд

$$f_i(t) = \max \left\{ \begin{array}{l} r(t) - c(t) + f_{i+1}(t+1), \quad \text{якщо експлуатувати механізм,} \\ r(0) + s(t) - I - c(0) + f_{i+1}(1), \quad \text{якщо замінити механізм.} \end{array} \right\} \quad (8.5)$$

Задача інвестування. Припустимо, що на початку кожного з наступних n років необхідно зробити інвестиції P_1, P_2, \dots, P_n . Є можливість вкласти капітал у два банки, перший з яких виплачує річний складний відсоток r_1 , а другий – r_2 . Для заохочення депозитів обидва банки виплачують новим інвесторам премії у вигляді відсотка від вкладеної суми. Преміальні змінюються від року до року й для i -го року дорівнюють q_{i1} і q_{i2} у першому й другому банках відповідно. Їх виплачують наприкінці року, і вони можуть бути інвестовані в один із двох банків на наступний рік. Розміщений у банку внесок повинен перебувати там до кінця розглянутого періоду. Необхідно розробити стратегію інвестицій на наступні n років.

Елементи моделі динамічного програмування визначають в такий спосіб. Етап i представляють порядковим номером року i , $i = \overline{1, n}$. Варіантами розв'язку на i -му етапі є суми I_i^1 і I_i^2 інвестицій у перший і другий банк відповідно. Станом x_i на i -му етапі є сума грошей на початок i -го року, які можуть бути інвестовані.

Оскільки $I_i^2 = x_i = I_i^1$, то

$$x_i = P_i + q_{i-1,1} I_{i-1}^1 + q_{i-1,2} (x_{i-1} - I_{i-1}^1) = P_i + (q_{i-1,1} + q_{i-1,2}) I_{i-1}^1 + q_{i-1,2} x_{i-1}.$$

Нехай $f_i(x_i)$ – оптимальна сума інвестицій для інтервалу від i -го до n -го року за умови, що на початку i -го року є грошова сума x_i . Далі позначимо через s_i суму, накопичену до кінця n -го року за умови, що I_i^1 і $(x_i - I_i^1)$ – обсяги інвестицій протягом i -го року в перший і другий банк відповідно. Позначивши $\alpha_i = (I^1 + r_i)$, $i = 1, 2$, сформулюємо задачу:

Максимізувати $Z = s_1 + s_2 + \dots + s_n$, де

$$s_i = I_i^1 \alpha_1^{n+1-i} + (x_i - I_i^1) \alpha_2^{n+1-i} = (\alpha_1^{n+1-i} - \alpha_2^{n+1-i}) I_i^1 + \alpha_2^{n+1-i} x_i, \quad i = \overline{1, n-1},$$

$$s_n = (\alpha_1 + q_{n1} - \alpha_2 - q_{n2}) I_n^1 + (\alpha_2 + q_{n2}) x_n.$$

Оскільки преміальні за n -й рік є частиною накопиченої грошової суми, у вираз для s_n додані q_{n1} і q_{n2} . В цьому випадку рекурентне рівняння для зворотного прогону має вигляд

$$f_i(x_i) = \max \{s_i + f_{i+1}(x_{i+1})\}, \quad i = \overline{1, n-1}. \quad (8.6)$$

Задача керування запасами. Однією з найвідоміших сфер використання методів динамічного програмування є така область як теорія керування запасами. Її предметом є розробка й дослідження математичних моделей систем, що займають проміжне положення між джерелами (виробниками) тих або інших

ресурсів та їх споживачами. При математичній формалізації процесів керування запасами дуже часто доводиться використовувати стрибкоподібні, недиференційовані та кусочно-безперервні функції. Як правило, це зумовлено необхідністю обліку ефектів концентрації, фіксованих витрат і плати за замовлення. У зв'язку з цим одержувані задачі трудно піддаються аналітичному розв'язанню класичними методами, однак можуть бути успішно вирішені за допомогою апарата динамічного програмування. Найпростіші задачі характеризуються постійним у часі попитом, миттєвим поповненням запасу та відсутністю дефіциту. Розглянемо модель з витратами на оформлення замовлення, у якій передбачається, що дефіцит не допускається. Введемо позначення: z_i - кількість замовленої продукції, D_i - потреба в продукції (попит), x_i - обсяг запасу на початок етапу i , K_i - витрати на оформлення замовлення, h_i - витрати на зберігання одиниці продукції, що переходить з етапу i в етап $i+1$.

Відповідну функцію витрат для етапу i задають формулою

$$C_i(z_i) = \begin{cases} 0, & z_i = 0 \\ K_i + c_i(z_i), & z_i > 0 \end{cases}$$

де $c_i(z_i)$ - функція граничних витрат при заданому значенні z_i .

Оскільки дефіцит не допускається, задача керування запасами зводиться до обчислення значень z_i , що мінімізують сумарні витрати, пов'язані з розміщенням замовлень, закупівлею та зберіганням продукції протягом n етапів. Витрати на зберігання на i -му етапі передбачаються пропорційними величині

$$x_{i+1} = x_i + z_i - D_i,$$

яка є обсягом запасу, що переходить з етапу i в етап $i+1$.

Для рекурентного рівняння процедури прямого прогону стан на етапі i визначають як обсяг запасу x_{i+1} на кінець етапу

$$0 \leq x_{i+1} \leq D_{i+1} + \dots + D_n.$$

Ця нерівність означає, що в граничному випадку запас x_{i+1} може задовольнити попит на всіх наступних етапах.

Нехай $f_i(x_{i+1})$ - мінімальні загальні витрати на етапах 1, 2, ... i при заданій величині запасу x_{i+1} на кінець етапу i . Тоді рекурентне рівняння алгоритму прямого прогону можна записати у вигляді

$$\begin{aligned} f_1(x_2) &= \min \{C_1(z_1) + h_1 x_2\}, \\ f_i(x_{i+1}) &= \min \{C_i(z_i) + h_i x_{i+1} + f_{i-1}(x_{i+1} + D_i - z_i)\}, \quad i = 2, n. \end{aligned} \quad (8.7)$$

Контрольні запитання

1. Для розв'язання яких задач призначений метод динамічного програмування?
2. Поясніть, що являють собою адитивна й мультиплікативна функції.
3. У чому полягає суть методу динамічного програмування?
4. Яким умовам повинна задовольняти задача, щоб для її розв'язання міг бути застосований алгоритм динамічного програмування?
5. Сформулюйте принцип оптимальності Беллмана, поясніть відсутність післядії.
6. Як визначають напрямок розв'язання задачі в алгоритмах динамічного програмування?
7. Сформулюйте математичну модель для задачі про планування робочої сили.
8. Випишіть основне рекурентне співвідношення, використовуване при розв'язанні задачі про планування робочої сили.
9. Сформулюйте математичну модель для задачі про заміну устаткування.
10. Випишіть основне рекурентне співвідношення, використовуване при розв'язанні задачі про заміну устаткування.
11. З якими особливостями задач керування запасами пов'язане застосування при їх розв'язанні апарата динамічного програмування?
12. Який вигляд має цільова функція в динамічній задачі керування запасами?
13. Випишіть основне рекурентне співвідношення, використовуване при розв'язанні динамічної задачі керування запасами.

ТЕМА 9.

ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ В УМОВАХ НЕВИЗНАЧЕНОСТІ Й РИЗИКУ

9.1. Загальна математична постановка задачі стохастичного програмування (СП)

Економічні системи функціонують в умовах невизначеності, що зумовлює ризикованість прийнятих рішень. Прийняття рішень в умовах невизначеності й ризику вимагає визначення альтернативних дій, причому, досліджуване явище може характеризуватися заданим імовірнісним розподілом певних параметрів. В такому випадку для прийняття рішень використовують методи **стохастичного програмування**. Сутність цих методів полягає в тому, що рішення залежить не тільки від керованих змінних $X=(x_1, x_2, \dots, x_n)$, а ще й від ряду **випадкових** некерованих параметрів $\omega=(\omega_1, \omega_2, \dots, \omega_k)$. Предметом стохастичного програмування є екстремальні задачі, в яких параметри умов або складові розв'язку – **випадкові величини**. Особливістю задач стохастичного програмування є те, що основні труднощі виникають не стільки при розробці методів їх розв'язання, скільки при постановці задачі. Це пов'язано з тим, що постановка задачі істотно залежить від структури наявної інформації й повинна відбивати особливості ухвалення рішення в умовах невизначеності. Зокрема, якщо вектор X є детермінованим, він не залежить від випадкових параметрів моделі, а інакше – треба враховувати його залежність від випадкових параметрів. Важливо також, що розуміють під максимізацією (мінімізацією) цільової функції: максимізація її абсолютних значень або максимізація її математичного сподівання або будь-якої іншої імовірнісної характеристики (наприклад, моди або середнього квадратичного відхилення). Треба вирішити також як повинні виконуватися обмеження: абсолютно для всіх ω або в середньому, або з малою імовірністю допускається порушення обмежень задачі.

Отже, постановка задачі стохастичного програмування вимагає врахування економічних особливостей досліджуваного явища, а також евристичного підходу до її формулювання.

При виборі цільової функції в задачах стохастичного програмування треба визначити, чи цікавить нас, у першу чергу, максимум математичного сподівання економічного критерію (наприклад, прибутку або рентабельності), або мінімум його дисперсії. Також як цільову функцію можна прийняти лінійну комбінацію математичного сподівання й дисперсії економічного показника або імовірність перевищення ним деякого фіксованого значення. Помітимо, що для стохастичних задач є актуальною багатокритеріальна оптимізація.

Щодо обмежень, то вимога, щоб оптимальний розв'язок задовольняв їм при будь-яких значеннях випадкових параметрів ω , є занадто жорстким. Зазвичай допускають невиконання обмежень з деякою досить малою імовірністю α .

Отже, задачі стохастичного програмування мають вигляд
 знайти $\max M[f(x, \omega)]$ (9.1)
 при обмеженнях

$$P\{g(x, \omega) \leq 0\} \geq 1 - \alpha. \quad (9.2)$$

У задачі (9.1)-(9.2) необхідно максимізувати середній сподіваний ефект за умови, що обмеження виконуються з імовірністю $1 - \alpha$.

Або інакше
 знайти $\max \xi$ (9.3)
 при обмеженнях

$$P\{f(x, \omega) \geq \xi, g(x, \omega) \leq 0\} \geq 1 - \alpha. \quad (9.4)$$

У задачі (9.3)-(9.4) додаткова вимога, щоб значення критерію ефективності було не менш за ξ з імовірністю $1 - \alpha$, а значення ξ було максимальним.

Оптимальні плани, отримані на підставі моделей (9.1)-(9.2) або (9.3)-(9.4) називають **М-планами**, оскільки критерієм оптимальності є математичне сподівання $f(x, \omega)$. Якщо як критерій прийнято дисперсію функції $f(x, \omega)$, то оптимальний план називають **Д-планом**. Іноді як критерій оптимальності приймають різницю $M[f(x, \omega)] - KD[f(x, \omega)]$, де K - відомий параметр.

9.2. Класифікація задач стохастичного програмування. Основні методи розв'язання

Постановки задач стохастичного програмування різняться за трьома ознаками: за характером рішень; за показником якості розв'язку; за способом розчленовування обмежень задачі.

Задачі з цільовою функцією виду $M[CX]$ називають **М-моделями**, задачі, в яких потрібно мінімізувати величину дисперсії, називають **Д-моделями**, а стохастичні задачі, в яких максимізують імовірність P , прийнято називати **Р-моделями**. До цієї самої групи моделей включають також і задачі, де потрібно мінімізувати або максимізувати поріг ξ .

До **одноетапних** задач стохастичного програмування належать задачі, в яких рішення приймають на основі відомих стохастичних характеристик розподілу випадкових параметрів умов задачі, що отримані до спостереження за реалізаціями поточних значень цих параметрів. При цьому повинне прийматися деяке найкраще в середньостатистичному значенні рішення.

Постановка задач у стохастичному програмуванні істотно залежить від можливості **уточнення** стану економічного середовища при реалізації оптимального рішення. Для економічних систем розробляють стратегічні й тактичні плани. У стратегічних планах враховують всі можливі значення ω . У певний момент часу в результаті спостереження стан економічного середовища стає відомим, тоді розробляють тактичний план, тобто знаходять розв'язок $X(\omega)$ при заданому ω . У загальному випадку спостереження не повністю визначають стан економічного середовища, тому етапи прийняття рішень можуть чергуватися з етапами спостережень. У цьому випадку виникає **Н-етапна** задача стохастичного програмування. Властивість плану адаптуватися до умов його реалізації,

що постійно змінюються, є необхідною для ефективного розвитку і функціонування економічної системи. Програмну частину плану вибирають так, щоб максимізувати сподівану корисність з урахуванням майбутньої адаптації. План-адаптація повинен бути оптимальним для конкретної економічної ситуації й при цьому зберігати стратегію розвитку системи в цілому.

Методи розв'язання стохастичних задач поділяють на дві групи - **прямі** й **непрямі**. Прямі методи використовують, якщо на підставі інформації про параметр ω можна побудувати функції $f(x, \omega)$ і $g_i(x, \omega)$. У непрямих методах стохастичну задачу приводять до задачі лінійного або нелінійного програмування, тобто розглядають детермінований аналог задачі стохастичного програмування.

Зокрема, **імовірнісне динамічне програмування** відрізняється від детермінованого тим, що стани й прибутки на кожному етапі є випадковими величинами. Моделі імовірнісного динамічного програмування виникають, наприклад, при розгляданні стохастичних моделей з керування запасами. **Одноетапні моделі** керування запасами відбивають ситуацію, коли для задоволення попиту протягом певного періоду продукцію замовляють тільки один раз. **Багатоетапні моделі** використовують при плануванні запасів на n періодів. Вони припускають, що попит у кожний період описується стаціонарною (незалежною від часу) щільністю імовірностей.

Апарат теорії ігор розрізняє стратегічні й **статистичні ігри**. В основі стратегічних ігор лежить припущення, що кожен з гравців діє активно, і їх інтереси є протилежними. У теорії статистичних ігор одним з гравців є природа, тобто сукупність зовнішніх обставин, в умовах яких доводиться приймати рішення. Неминуchoю платою за спробу одержати рішення в умовах неповної інформації про закони природи є прийняття помилкових рішень. Теорія статистичних ігор дозволяє виробити таку стратегію щодо прийняття рішень, що хоча й не виключає можливості прийняття невірних рішень, але зводить до мінімуму пов'язані з цим небажані наслідки.

Розглянемо приклад. Нехай необхідно зробити запас n товарів у кількості $X=(x_1, x_2, \dots, x_n)$, на які є випадковий попит $\omega=(\omega_1, \omega_2, \dots, \omega_n)$... Нестачу одиниці j -го товару обкладають штрафом c_j , тобто $C=(c_1, c_2, \dots, c_n)$, а витрати на зберігання одиниці відповідного товару, що не вдалося збути, задані вектором $d=(d_1, d_2, \dots, d_n)$. Функція збитку, що відповідає розв'язку x , має вигляд

$$f(x, \omega) = \sum_{j=1}^n \{C_j \max(0, \omega_j - x_j) + d_j \max(0, x_j - \omega_j)\},$$

де $C_j \max(0, \omega_j - x_j)$ - штраф за незадоволення попиту на j -й вид товару; $d_j \max(0, x_j - \omega_j)$ - витрати на зберігання j -го виду товару. Для знаходження оптимального розв'язку цієї задачі необхідно знати функцію розподілу випадкової величини ω . Оскільки така функція невідома, вважають, що ω розподілена рівномірно. При цьому необхідно враховувати, що це допущення може привести до ухвалення неправильного рішення.

9.3. Імітаційне моделювання

Методи імітаційного моделювання дозволяють зібрати необхідну інформацію про поведінку системи шляхом створення її комп'ютеризованої моделі. Імітаційне моделювання не вирішує оптимізаційних задач, а є технікою оцінки значень функціональних характеристик системи, що моделюють. Методи імітаційного моделювання знаходять широке застосування в економічних і комерційних задачах, включаючи оцінку поведінки споживача, визначення цін, економічне прогнозування діяльності фірм, у соціальних задачах та ін.

Попередником сучасного імітаційного моделювання вважають метод Монте-Карло, основна ідея якого полягає у використанні вибірки випадкових чисел для одержання імовірнісних або детермінованих оцінок будь-яких величин. Імітація є випадковим експериментом, тому будь-який результат імітаційного моделювання піддається експериментальним помилкам і підлягає статистичній перевірці. Для будь-якого експерименту також важливим є питання, яким повинен бути обсяг вибірки n і число реалізацій досліджуваної випадкової величини N .

Відмінність сучасних імітаційних моделей від методу Монте-Карло полягає в тому, що імітаційна модель зазвичай пов'язана з вивченням реально існуючої системи, поведінка якої є функцією часу. Існує два типи імітаційних моделей. **Безперервні моделі** використовують для систем, поведінка яких змінюється в часі безупинно. Безперервні імітаційні моделі зазвичай представляють у вигляді різницево-диференціальних рівнянь, які описують взаємодію між різними елементами системи. **Дискретні моделі** описують системи, поведінка яких змінюється тільки в певні моменти часу. Типовим прикладом такої моделі є черга, що є системою, зміни в якій відбуваються лише тоді, коли клієнт надходить у чергу або залишає систему після обслуговування. Це означає, що в будь-якій дискретній імітаційній моделі є дві головних події, за якими необхідно досліджувати систему. В імітаційній моделі події, пов'язані з прибуттям, визначають часом між надходженнями клієнтів, а події, пов'язані з їх доглядом, - часом обслуговування.

Випадковість в імітаційних моделях виникає, коли інтервал часу t між однорідними подіями є випадковим. Відомий ряд методів одержання послідовних випадкових значень $t=t_1, t_2, \dots$, що мають заданий розподіл імовірностей $f(x)$. Розглянемо два з них: метод зворотних функцій і метод згортки.

Обидва методи засновані на використанні незалежних однаково розподілених випадкових чисел, що мають рівномірний розподіл на інтервалі $[0,1]$. Метод зворотних функцій використовують для безперервних розподілів, наприклад для експонентного або рівномірного. Метод згортки використовують в складніших ситуаціях, наприклад, при генеруванні випадкових чисел, що мають нормальний розподіл або розподіл Пуассона.

Метод зворотних функцій вимагає виконання наступних дій. Спочатку генерують випадкове число R з інтервалу $[0,1]$, потім обчислюють шукане випадкове число $x=F^{-1}(R)$, де F^{-1} – функція, зворотна до функції розподілу $F(x)=P\{X<x\}$ (рис. 9.1). Метод заснований на тому, що якщо функцію розподілу

$F(x)$ розглядати як випадкову величину, вона розподілена рівномірно на інтервалі $[0,1]$.

Розглянемо приклад. Нехай час появи клієнтів розподілений за експонентним законом з параметром $\lambda=4$. Функція розподілу має вигляд

$$F(t) = 1 - e^{-\lambda t} = 1 - e^{-4t}. \text{ Врахуємо, що}$$

$$F(t)=R, \text{ одержимо } t = \frac{1}{\lambda} \ln(1-R). \text{ Оскільки}$$

R - випадкове число з інтервалу $[0,1]$ і $(1-R)$ також випадкове число з того самого інтервалу, можна замінити $(1-R)$ на R . Нехай $R=0,9$, тоді одержимо одне конкретне значення інтервалу часу між клієнтами

$$t = \frac{1}{4} \ln(1-0,9) = 0,577.$$

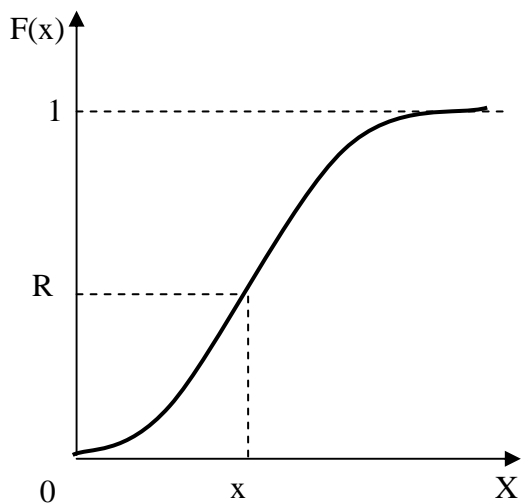


Рис. 9.1 – Метод зворотних функцій

Значення R – повинні вибиратися випадково з інтервалу $[0,1]$ і підпорядковуватися рівномірному розподілу.

Основна ідея **методу згорток** полягає в тому, щоб виразити шукану випадкову величину у вигляді суми інших випадкових величин, для яких легко отримати реалізації випадкових значень.

Для одержання значень, що відповідають нормальному розподілу з математичним сподіванням m і стандартним відхиленням σ використовують центральну граничну теорему. Нагадаємо, що суть її зводиться до того, що сума n однаково розподілених випадкових величин прагне до нормального розподілу при нескінченному збільшенні n . Нехай $x=R_1+R_2+\dots+R_n$, де R_1, R_2, \dots, R_n – випадкові числа, рівномірно розподілені в інтервалі $[0,1]$. Відповідно до центральної граничної теореми випадкова величина x є асимптотично нормальною величиною із середнім $n/2$ і дисперсією $n/12$. Тоді випадкову величину X з математичним сподіванням m і стандартним відхиленням σ визначають за формулою

$$X = m + \sigma \left(\frac{x - \frac{n}{2}}{\sqrt{\frac{n}{12}}} \right).$$

У практичних розрахунках для зручності зазвичай приймають $n=12$, тоді $X = m + \sigma(x - 6)$.

Імітаційне моделювання являє собою статистичний експеримент. Його результати повинні ґрунтуватися на відповідних статистичних перевірках з використанням, наприклад, довірчих інтервалів і методів перевірки гіпотез. Для цього спостереження повинні задовольняти наступним вимогам: мати стаціонарні розподіли, тобто такі, що не змінюються під час проведення експерименту, підпорядковуватися нормальному розподілу та бути незалежними.

Характер імітаційних обчислень стимулює створення спеціалізованих мов програмування. У цей час на ринку програмних продуктів для моделювання домінують комерційні пакети Arena, AweSim і GPSS/H, які мають розвинений інтерфейс, що спрощує процес створення імітаційних моделей.

9.4. Прийняття рішень в умовах невизначеності й ризику

В теорії прийняття рішень використовують процедури вибору найкращої з кількох можливих альтернатив. Наскільки правильним буде вибір, залежить від якості даних, використовуваних при описі ситуації, в якій приймають рішення. З цього погляду процес прийняття рішень може належати до одної з трьох можливих умов. Прийняття рішень в умовах визначеності, коли дані відомі точно; прийняття рішень в умовах ризику, коли дані можна описати за допомогою імовірнісних розподілів; прийняття рішень в умовах невизначеності, коли даним не можна приписати вагові коефіцієнти, які зумовлювали б ступінь їх значущості в процесі прийняття рішень.

Якщо рішення приймають в умовах ризику, вагові коефіцієнти альтернативних рішень описують імовірнісними розподілами. Для ухвалення рішення в цьому випадку використовують **критерій сподіваного значення**, відповідно до якого альтернативні рішення порівнюють з погляду максимізації сподіваного прибутку або мінімізації сподіваних витрат. При цьому припускають, що прибуток (витрати), пов'язаний з кожним альтернативним рішенням, є випадковою величиною. Розглянемо ситуацію, пов'язану з ухваленням рішення при наявності кінцевого числа альтернатив і точних значень матриці доходів.

Необхідно вкласти на фондовій біржі 10 тис.дол. в акції однієї з двох компаній А або В. Акції компанії А є ризикованими, але можуть принести 50% прибутку від суми інвестиції протягом року. Якщо умови фондової біржі будуть несприятливі, сума інвестиції може знецінитися на 20%. Компанія В забезпечує безпеку інвестицій з 15% прибутку в умовах підвищення котирувань на біржі і тільки 5% в умовах зниження котирувань. Аналітичні публікації з імовірністю 60% прогнозують підвищення котирувань. В яку компанію краще вкласти гроші? Складемо таблицю

Альтернативні рішення	Прибуток від інвестиції 10 тис. дол.	
	При підвищенні котирувань	При зниженні котирувань
Акції компанії А	5000	-2000
Акції компанії В	1500	500
Імовірність	0,6	0,4

Визначимо сподіваний прибуток. Для акцій компанії А

$$5000 \times 0,6 + (-2000) \times 0,4 = 2200 \text{ дол.}$$

Для акцій компанії В

$$1500 \times 0,6 + 500 \times 0,4 = 1100 \text{ дол.}$$

Отже, рішенням, заснованим на цих обчисленнях, є покупка акцій компанії А.

В цьому випадку підвищення й зниження котирувань на біржі є станами природи. У загальному випадку задача прийняття рішень може включати n станів природи і m альтернатив. Якщо p_j – імовірність j -го стану природи, а a_{ij} – платіж, пов'язаний з ухваленням рішення, то очікуваний платіж для рішення i обчислюють в такий спосіб

$$M[v_i] = a_{i1}p_1 + a_{i2}p_2 + \dots + a_{in}p_n, \quad \text{де} \quad \sum p_j = 1.$$

Найкращим рішенням буде те, що відповідає $M[v_i]^* = \max\{M[v_i]\}$ або $M[v_i]^* = \min\{M[v_i]\}$ залежно від того, чи є платіж у задачі доходом або збитком.

Критерій сподіваного значення має дві модифікації, перша з яких перебуває у визначенні **апостеріорних імовірностей** на основі експерименту над досліджуваною системою, а друга – у визначенні **функції корисності**.

Імовірності, які використовують для формулювання критерію сподіваного значення, визначають, як правило, на підставі попередньо накопиченої інформації. Іноді виявляється можливим перерахувати ці ймовірності за допомогою поточної інформації, отриманої на підставі вибіркових (або експериментальних) даних. Одержувані при цьому імовірності називають апостеріорними (або бейєсовськими) на відміну від апріорних, отриманих з вихідної інформації.

Функцію корисності $U(x)$ використовують, коли важливіше не реальна величина платежів, а скоріше їх корисність, зумовлена ставленням особи, що приймає рішення (ОПР), до ризику. Нехай ОПР має шанс 50 на 50, що інвестиція в 20 тис. дол. або принесе прибуток в 40 тис. дол. або буде цілком загубленою. Різні індивідууми проявляють різне ставлення до ризику, тобто вони виявляють стосовно ризику різну корисність. У розглянутій ситуації найкращий платіж дорівнює 40 тис. дол., а найгірший – -20 тис. дол. Встановимо довільну шкалу корисності U – від 0 до 100. 0 відповідає корисності -20, а 100 – 40, тобто $U(-20)=0$; $U(40)=100$. Для визначення загального вигляду функції корисності визначимо корисність в точках між -20 і 40.

Якщо ставлення до ризику ОПР байдуже, то функція корисності є прямою, що з'єднує точки $(-20, 0)$ і $(40, 100)$, як показано на рис. 9.2. В цьому випадку як реальні гроші, так і їх корисність дають співпадаючі рішення. Нехай ОПР X не прихильне до ризику, тоді для нього при зміні в 10 тис. дол. вправо й уліво від 0 збільшення прибутку змінює корисність на величини ab і bc відповідно, причому, $ab < bc$. До таких самих змін ОПР Y ставиться інакше, у цьому випадку $de > ef$. Визначимо корисність, що відповідає проміжним значенням -10; 0; 10; 20. Функцію корисності обчислюють за формулою

$$U(x) = p(-20) + (1-p)U(40).$$

Для визначення значення $U(x)$ просять ОПР повідомити свою перевагу між гарантованою наявною сумою x і можливістю з імовірністю p програти 20 тис. дол. або з імовірністю $(1-p)$ виграти 40 тис. дол. Під перевагою тут розуміють вибір такої імовірності p , при якій пропоновані варіанти однаково привабливі.

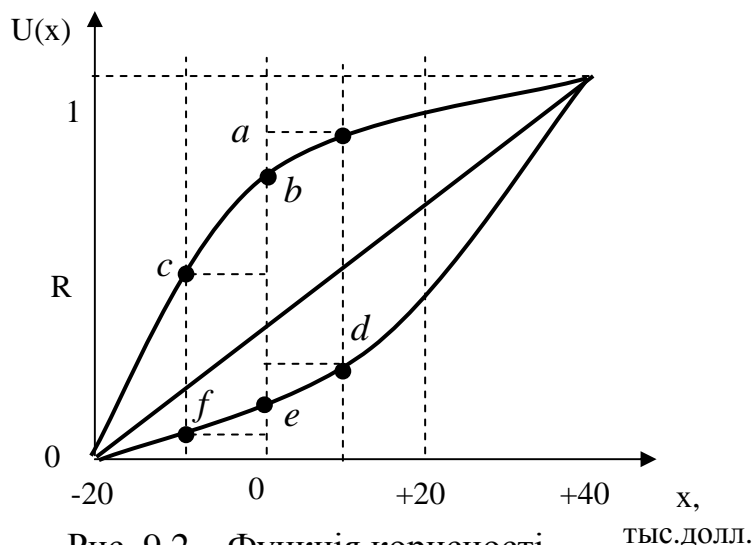


Рис. 9.2 – Функція корисності

Наприклад, при $x=20$ тис. дол. ОПР повідомляє, що $p=0,8$, тоді $U(20) = 100 - 100 \cdot 0,8 = 20$. Аналогічно знаходять ряд точок для визначення форми функції корисності, а потім визначають шукану криву за допомогою регресійного аналізу або лінійної інтерполяції.

Прийняття рішень в умовах невизначеності, як і в умовах ризику, вимагає ви-

значення альтернативних дій, яким відповідають «платежі», що залежать від **станів природи**. Запишемо матрицю платежів у задачі прийняття рішень із m можливими діями й n станами природи

	ω_1	ω_2	...	ω_n
a_1	$v(a_1, \omega_1)$	$v(a_1, \omega_2)$...	$v(a_1, \omega_n)$
a_2	$v(a_2, \omega_1)$	$v(a_2, \omega_2)$...	$v(a_1, \omega_n)$
...
a_m	$v(a_m, \omega_1)$	$v(a_m, \omega_2)$...	$v(a_m, \omega_n)$

Елемент a_i представляє i -й можливий розв'язок, а елемент ω_j - j -й стан природи. Плата або дохід, пов'язаний з розв'язком a_i і станом ω_j дорівнює $v(a_i, \omega_j)$.

Відмінність між прийняттям рішень в умовах ризику й невизначеності полягає в тому, що в умовах невизначеності імовірнісний розподіл, що відповідає станам ω_j невідомий. Ця обставина зумовила розвиток спеціальних критеріїв для аналізу ситуації, пов'язаної з прийняттям рішень: критерію Лапласа, мінімаксного критерію, критерію Севіджа та критерію Гурвіца. Ці критерії відрізняються за ступенем консерватизму особи, що приймає рішення.

Критерій Лапласа спирається на принцип недостатньої підстави, який говорить, що оскільки розподіл імовірностей станів $P\{\omega_j\}$ невідомий, немає підстав вважати їх різними. Отже, роблять припущення, що імовірності всіх ста-

нів природи рівні між собою, тобто $P\{\omega_1\} = P\{\omega_2\} = \dots = P\{\omega_n\} = 1/n$. Якщо при цьому $v(a_i, \omega_j)$ є прибутком, то найкращим рішенням є те, що забезпечує

$$\max_{ai} \left\{ \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n v(a_i, \omega_j) \right\}.$$

Якщо величина $v(a_i, \omega_j)$ є видатками, то максимум замінюється на мінімум.

Максимінний (мінімаксний) критерій заснований на консервативному обережному поведженні особи, що приймає рішення, і зводиться до вибору найкращої альтернативи з найгірших. Якщо величина $v(a_i, \omega_j)$ є прибутком, то відповідно до максимінного критерію за оптимальне вибирають рішення, що забезпечує

$$\max_{ai} \left\{ \min_{\omega j} v(a_i, \omega_j) \right\}.$$

Якщо величина $v(a_i, \omega_j)$ є втратами, використовують мінімаксний критерій

$$\min_{ai} \left\{ \max_{\omega j} v(a_i, \omega_j) \right\}.$$

Критерій Севіджа знижує консерватизм мінімаксного (максимінного) критерію шляхом заміни матриці платежів $v(a_i, \omega_j)$ матрицею втрат $r(a_i, \omega_j)$, що визначають в такий спосіб

$$r(a_i, \omega_j) = \begin{cases} \max_{ak} \{v(a_k, \omega_j)\} - v(a_i, \omega_j), & \text{якщо } v - \text{дохід,} \\ v(a_{ui}, \omega_j) - \min_{ak} \{v(a_k, \omega_j)\}, & \text{якщо } v - \text{втрата.} \end{cases}$$

Розглянемо приклад. Є матриця платежів

	ω_1	ω_2
a_1	11000	90
a_2	10000	10000

Максимум рядка 1 становить 11000, а рядка 2 – 10000 (мінімакс). Застосування мінімаксного критерію призводить до того, що рішення a_2 з фіксованими втратами 10000 є кращим. Однак можна вибрати й a_1 , оскільки в цьому випадку існує можливість втратити лише 90, якщо реалізується стан ω_2 при потенційному виграші 11000.

Визначимо, який результат вийде, якщо в мінімаксовому критерії замість матриці платежів $v(a_i, \omega_j)$ використати матрицю втрат $r(a_i, \omega_j)$.

	ω_1	ω_2
a_1	1000	0
a_2	0	9910

Максимум рядка 1 становить 1000 (мінімакс), а рядка 2 – 9910. Як бачимо, мінімаксовий критерій, застосований до матриці втрат, призводить до вибору рішення a_1 .

Критерій Гурвіца охоплює ряд різних підходів до прийняття рішень – від найоптимістичнішого до найпесимістичнішого. Нехай $0 \leq \alpha \leq 1$ і величини $v(a_i, \omega_j)$ є доходами. Тоді рішення, обраному за критерієм Гурвіца, відповідає

$$\max_{ai} \left\{ \alpha \max_{\omega j} v(a_i, \omega_j) + (1 - \alpha) \min_{\omega j} v(a_i, \omega_j) \right\}.$$

Параметр α - показник оптимізму. Якщо $\alpha=0$, критерій Гурвіца стає еквівалентним застосуванню мінімаксового критерію. Якщо $\alpha=1$, критерій Гурвіца стає занадто оптимістичним, тому що розраховує на найкраще з найкращих рішень. Можна конкретизувати ступінь оптимізму вибором величини α з інтервалу $[0, 1]$. Найрозумнішим представляється вибір $\alpha=0,5$.

Якщо величини $v(a_i, \omega_j)$ є втратами, то критерій приймає наступний вигляд

$$\min_{ai} \left\{ \alpha \min_{\omega j} v(a_i, \omega_j) + (1 - \alpha) \max_{\omega j} v(a_i, \omega_j) \right\}.$$

Контрольні запитання

1. Поясніть сутність задач стохастичного програмування.
2. Яку стохастичну задачу називають одноетапною? Багатоетапною? Що розуміють під етапами?
3. Дайте загальну характеристику методів стохастичного програмування.
4. Які класи задач стохастичного програмування прийнято розрізняти?
5. Поясніть розходження між стратегічною й статистичною іграми.
6. Для чого використовують метод імітаційного моделювання? У чому відмінність безперервних і дискретних імітаційних моделей?
7. Для чого призначений метод зворотних функцій? Поясніть суть методу.
8. Для чого призначений метод згорток? Поясніть суть методу.
9. Яка відмінність між прийняттям рішень в умовах визначеності, в умовах невизначеності та в умовах ризику?
10. В яких випадках для ухвалення рішення використовують критерій сподіваного значення?

ТЕМА 10. ЕЛЕМЕНТИ ТЕОРІЇ ІГОР

10.1. Основні поняття теорії ігор

При вивченні процесів прийняття розв'язань кількома суб'єктами, інтереси яких можуть не збігатися, виникають задачі з багатьма цільовими функціями (критеріями). Область математики, що вивчає дані проблеми, одержала назву **теорії ігор**. Задачі теорії ігор належать до області прийняття рішень в умовах невизначеності, а їх специфіка полягає в тому, що, як правило, мається на увазі невизначеність, яка виникає в результаті дій двох або більше «розумних» супротивників, здатних оптимізувати свою поведінку за рахунок інших. Такі ситуації є типовими в практичній діяльності менеджерів, маркетингологів та інших фахівців, що приймають рішення в умовах гострої конкуренції, неповноти інформації та ін.

Одним з основних питань у задачах з колективним вибором рішень є питання про визначення оптимальності, тобто питання, які рішення можна визнавати найкращими в ситуації оптимізації за кількома критеріями, що відображає різні інтереси. Багато методів вирішення проблем теорії ігор ґрунтуються на зведенні їх до задач математичного програмування. Теорія ігор бере початок від робіт Е. Бореля (1921 р.), а принциповим етапом у її становленні як самостійного наукового напрямку стала монографія Дж. Неймана, що вийшла в 1944 р.

Термін **гра** застосовують для позначення сукупності правил і угод, якими керуються суб'єкти, поведінку яких ми вивчаємо. Кожний такий суб'єкт k , де $k = \overline{1, K}$, або **гравець**, характеризується наявністю індивідуальної системи цільових настанов і **стратегій** $s_1^k, s_2^k, \dots, s_{m_k}^k$, тобто можливих варіантів дій у грі.

Розповсюджений спосіб математичного опису гри ґрунтується на завданні функцій $f_k(s_{i1}^1, s_{i2}^2, \dots, s_{ik}^k, \dots, s_{iK}^K)$, кожна з яких визначає результат (платіж, виграш), одержуваний k -м гравцем залежно від набору стратегій $S = (s_{i1}^1, s_{i2}^2, \dots, s_{ik}^k, \dots, s_{iK}^K)$, застосованого всіма учасниками гри. Функції f_k також називають **функціями виграшу**, або **платіжними функціями**. У тому випадку, якщо для будь-яких S

$$\sum_{k=1}^K f_k(s) = 0,$$

гру називають **грою з нульовою сумою**. Гру із двома учасниками і нульовою сумою називають **антагоністичною**. Антагоністичні ігри, тобто ігри, в яких виграш одного учасника дорівнює програшу іншого, у зв'язку з відносно простою постановкою задачі є найбільш вивченим розділом теорії ігор. Однак зміст теорії ігор, безумовно, не вичерпується ними. У класифікації ігрових моделей виділяють ігри з кінцевими і нескінченними наборами стратегій у гравців, виділяють ігри за можливими кількостями ходів учасників. Також ігри поділяють на некооперативні та кооперативні, тобто ті, в яких функції виграшу учасників

залежать від утворених ними коаліцій. Крім цього ігри можна розрізняти за обсягом інформації, наявної в гравців щодо минулих ходів. В цьому зв'язку їх поділяють на ігри з повною і неповною інформацією.

Розглянемо докладніше антагоністичні ігри та їх основні властивості. Зручним способом завдання гри двох учасників з нульовою сумою є **платіжна матриця**. Звідси, до речі, впливає ще одна їх назва — **матричні ігри**. Кожний елемент платіжної матриці a_{ij} містить числове значення виграшу гравця I (програшу гравця II), якщо перший застосовує стратегію i , а другий — стратегію j . Терміни виграш і програш треба розуміти в широкому змісті, оскільки вони можуть приймати від'ємні значення й означати протилежне. Нетривіальність задачі, насамперед, полягає в тому, що кожний з гравців робить свій вибір, не знаючи про вибір іншого, що істотно ускладнює процес оптимізації обраної стратегії.

Класичним прикладом антагоністичної гри є гра з двома учасниками, що загадують незалежно один від одного числа. Передбачають, що якщо їх сума опиниться парною, то виграш, рівний 1, дістається першому гравцеві, а якщо непарною, то другому. Поклавши, що для обох гравців загадування непарного числа є першою стратегією, а парного - другою, можемо записати платіжну матрицю цієї гри:

$$\begin{array}{c|cc}
 & \text{н/п} & \text{п} \\
 \hline
 \text{н/п} & 1 & -1 \\
 \text{п} & -1 & 1
 \end{array} \quad (10.1)$$

Рядки матриці (10.1) відповідають стратегіям гравця I , стовпці - стратегіям гравця II , а її елементи - результатам першого гравця. Також з визначення гри випливає, що елементи цієї матриці, узяті із зворотним знаком, відповідають виграшам другого гравця.

Складнішу і змістовнішу платіжну матрицю можна отримати, якщо трохи модифікувати запропоновану гру. Припустимо, що обоє учасники мають право загадувати числа від 1 до 4, що становить їх відповідні стратегії. У випадку якщо результат додавання задуманих чисел буде парним, то другий гравець виплачує першому суму, що вийшла, а якщо непарним, то перший - другому. Запишемо платіжну матрицю для такої гри:

$$A = \begin{array}{c|cccc|c}
 & 2 & -3 & 4 & -5 & 1 \\
 & -3 & 4 & -5 & 6 & 2 \\
 & 4 & -5 & 6 & -7 & 3 \\
 & -5 & 6 & -7 & 8 & 4 \\
 & 1 & 2 & 3 & 4 &
 \end{array} \quad (10.2)$$

Як відзначено вище, найважливішим у теорії ігор є питання про оптимальність розв'язку (вибору стратегії) для кожного з гравців. Проаналізуємо з цього погляду певну матричну гру, для якої задано платіжну матрицю $A = \|a_{ij}\|_{m \times n}$. При виборі гравцем I стратегії i його гарантований дохід незалежно від дій гравця II складе $\min_j a_{ij}$. Оскільки він може вибирати i самостійно, доцільно цей вибір зробити таким, щоб він при будь-якій стратегії супротивника максимізував величину гарантованого доходу, тобто забезпечував одержання $\max_i \left(\min_j a_{ij} \right)$. Такий принцип вибору стратегії одержав назву **принцип максиміна**, а розмір гарантованого виграшу – **нижньої ціни гри**. З іншого боку, аналогічні міркування можна провести з приводу дій другого гравця. Його найбільший програш при виборі стратегії j складе $\max_i a_{ij}$, і, отже, йому треба вибирати стратегію так, щоб мінімізувати величину програшу при будь-яких діях суперника, тобто забезпечити $\min_j \left(\max_i a_{ij} \right)$. у цьому полягає суть **принципу мінімакса**, розмір програшу називають **верхньою ціною гри**.

Можна довести справедливості наступного співвідношення:

$$\max_i \min_j a_{ij} \leq \min_j \max_i a_{ij}. \quad (10.3)$$

Однак очевидний інтерес представляє ситуація, при якій значення виграшу (платежу), одержуваного гравцем I при виборі ним максимінної стратегії, дорівнює платежу (програшу) II -го гравця при мінімаксній стратегії

$$\max_i \min_j a_{ij} = \min_j \max_i a_{ij}. \quad (10.4)$$

В цьому випадку говорять, що гра має **сідлову точку**. Збіг значень гарантованих виграшів гравців при максимінній і мінімаксній стратегії означає можливість досягнення в грі деякого оптимального (стабільного, рівноважного) стану, від якого не вигідно відхилитися жодному з учасників. Поняття «оптимальність» тут означає, що жоден розумний (обережний) гравець не прагне змінити свою стратегію, оскільки його супротивник, зможе вибрати таку стратегію, що дасть гірший для першого результат. Стратегії i^* і j^* , що утворюють сідлову точку, називають **оптимальними**, а значення $v = a_{i^*j^*}$ називають **ціною гри**. Трійку (i^*, j^*, v) вважають **розв'язком матричної гри із сідловою точкою**.

Неважко помітити, що не всяка гра має сідлову точку. Зокрема, як гра (10.1), так і гра (10.2) сідлової точки не мають. Прикладом гри, що має сідлову точку, є гра з платіжною матрицею (10.5).

$$A = \begin{vmatrix} 7 & 10 & 4 & 1 \\ 6 & 8 & 5^* & 17 \\ 8 & -3 & 2 & 11 \end{vmatrix} \quad (10.5)$$

У цій матриці мінімальні (гарантовані) виграші першого гравця за рядками дорівнюють 1, 5 і (-3). Отже, його максимінному вибору відповідатиме стратегія 2, що гарантує виграш 5. Для другого гравця максимальні програші за стовпцями матриці складуть 8, 10, 5, 17, тому має сенс зупинитися на стратегії 3, при якій він програє тільки 5. Отже, друга стратегія першого гравця й третя стратегія другого утворюють сідлову точку із значенням 5, тобто гра з матрицею (10.5) має розв'язання (2; 3; 5).

10.2. Змішані стратегії. Основна теорема теорії ігор

Подальший розвиток теорії матричних ігор ґрунтується на дослідженні гри як певного повторюваного процесу. Дійсно, навряд чи можна дати змістовні рекомендації з такого питання, як треба поводитися учасникам однократно проведеної гри, що не має сідлової точки. У випадку ж її багаторазових повторів природною і плідною уявляється ідея *рандомізації* вибору стратегій гравцями, тобто внесення до процесу вибору елемента випадковості. Дійсно, систематичне відхилення, наприклад, гравця *I* від максимінної стратегії з метою збільшення виграшу може бути зафіксованим другим гравцем і покарано. В той самий час абсолютно хаотичний вибір стратегій не принесе в середньому найкращого результату.

Змішаною стратегією гравця *I* у грі з матрицею $A = \|a_{ij}\|_{m \times n}$ називають впорядкований набір дійсних чисел x_i , $i = \overline{1, m}$, що задовольняють умовам

$$x_i \geq 0, \quad i = \overline{1, m}; \quad \sum_{i=1}^m x_i = 1. \quad (10.6)$$

Числа x_i інтерпретують як імовірності застосування гравцем *I* стратегій 1, 2, ..., *m*, які, на відміну від змішаних, називають **чистими стратегіями**.

Аналогічно вводять поняття змішаних стратегій гравця *II*, які визначають як набір чисел y_j , $j = \overline{1, n}$, що задовольняють умовам

$$y_j \geq 0, \quad j = \overline{1, n}; \quad \sum_{j=1}^n y_j = 1. \quad (10.7)$$

Тоді, якщо гравець *I* застосовує змішану стратегію $x = (x_1, x_2, \dots, x_m)$, а гравець *II* змішану стратегію $y = (y_1, y_2, \dots, y_n)$, математичне сподівання виграшу гравця *I* (програшу гравця *II*) визначають співвідношенням

$$F(x, y) = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n a_{ij} x_i y_j. \quad (10.8)$$

Надалі через *X* позначимо множину припустимих змішаних стратегій гравця *I*, зумовлену умовою (10.6), а через *Y* - зумовлену умовою (10.7) множину припустимих змішаних стратегій гравця *II*.

До пошуку розв'язку гри в змішаних стратегіях можна застосовувати критерії максиміна-мінімакса. Відповідно до них гравець *I* вибиратиме свою

змішану стратегію $x=(x_1, x_2, \dots, x_m)$ так, щоб максимізувати найменший середній виграш:

$$\max_{x \in X} \left[\min_{y \in Y} \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n a_{ij} x_i y_j \right], \quad (10.9)$$

який дорівнює

$$\max_{x \in X} \left[\min \left\{ \sum_{i=1}^m a_{i1} x_i, \sum_{i=1}^m a_{i2} x_i, \dots, \sum_{i=1}^m a_{in} x_i \right\} \right], \quad (10.10)$$

а гравець II - свою змішану стратегію так, щоб мінімізувати найбільший середній програш:

$$\min_{y \in Y} \left[\max_{x \in X} \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n a_{ij} x_i y_j \right], \quad (10.11)$$

також рівний

$$\min_{y \in Y} \left[\max \left\{ \sum_{j=1}^n a_{1j} y_j, \sum_{j=1}^n a_{2j} y_j, \dots, \sum_{j=1}^n a_{mj} y_j \right\} \right]. \quad (10.12)$$

За аналогією з (10.3) для будь-яких $x \in X$ і $y \in Y$ справедлива нерівність

$$\max_{x \in X} \left[\min_{y \in Y} \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n a_{ij} x_i y_j \right] \leq \min_{y \in Y} \left[\max_{x \in X} \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n a_{ij} x_i y_j \right] \quad (10.13)$$

Стратегії $x^* \in X$ і $y^* \in Y$ називають **оптимальними змішаними стратегіями**, якщо для будь-яких $x \in X$ і $y \in Y$ справедлива рівність

$$F(x^*, y^*) = \max_{x \in X} \left[\min_{y \in Y} \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n a_{ij} x_i y_j \right] = \min_{y \in Y} \left[\max_{x \in X} \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n a_{ij} x_i y_j \right]. \quad (10.14)$$

$v = F(x^*, y^*)$ називають ціною гри, і якщо x^* і y^* існують, говорять, що **гра має розв'язання в змішаних стратегіях** (x^*, y^*, v).

Справедлива фундаментальна теорема Дж. Неймана, (приведемо без доказу).

Теорема 10.1 (основна теорема матричних ігор). Будь-яка матрична гра має розв'язання в змішаних стратегіях.

Значення й нетривіальність теореми (10.1) зумовлені насамперед тим, що у загальному випадку матричні ігри в чистих стратегіях розв'язання не мають.

10.3. Зведення гри двох гравців до задачі лінійного програмування

Задачу, розв'язувану першим гравцем, (10.10) було сформульовано як максимізацію найменшої з сум

$$\sum_{i=1}^m a_{ij} x_i ,$$

але якщо визначити деяке x_{m+1} , для якого виконується

$$x_{m+1} \leq \sum_{i=1}^m a_{ij} x_i , \quad (10.15)$$

її можна звести до задачі лінійного програмування:

$$\begin{array}{ll} \text{знайти} & F(x) > \max \\ \text{при обмеженнях} & \end{array} \quad (10.16)$$

$$\sum_{i=1}^m a_{ij} x_i \geq x_{m+1}, \quad j = \overline{1, n}; \quad \sum_{i=1}^m x_i = 1; \quad x_i \geq 0; \quad i = \overline{1, m}. \quad (10.17)$$

Провівши аналогічні міркування, приходимо до того, що задача мінімізації найбільшого сподіваного програшу, розв'язувана гравцем II (10.12), зводиться до задачі лінійного програмування

$$F(x) > \min, \quad (10.18)$$

$$\sum_{j=1}^n a_{ij} y_j \leq y_{n+1}, \quad i = \overline{1, m}; \quad \sum_{j=1}^n y_j = 1; \quad y_j \geq 0; \quad j = \overline{1, n} \quad (10.19)$$

Отже, ми одержуємо можливість застосовувати всі можливості апарата лінійного програмування для пошуку оптимальних стратегій обох гравців.

Досить легко перевірити, що задачі (10.16)-(10.17) і (10.18)-(10.19) утворюють двоїсту пару. Тут у певному змісті ми повернулися до взаємозв'язку між наявністю розв'язку в деякій оптимізаційній задачі й існуванням сідлової точки у відповідній функції Лагранжа. В цьому випадку аналогічний зв'язок простежується між сідловою точкою гри й розв'язком пари задач оптимізації.

Графічний метод вирішення гри. Слід зазначити, що застосування для розв'язання задач (10.16)-(10.17), (10.18)-(10.19) стандартних алгоритмів лінійного програмування далеко не завжди є раціональним. Крім цього існують інші методи, які ґрунтуються на використанні специфіки цих задач. Зупинимось на дуже простому класичному способі пошуку оптимальних змішаних стратегій у матричних іграх, де один з учасників має тільки дві стратегії (це так звані $2 \times n$ і $m \times 2$ ігри).

Для визначеності покладемо, що гравець I має можливість вибирати між двома стратегіями з імовірностями x_1 і $x_2=1-x_1$, тоді його очікувані виграші, що відповідають чистим стратегіям гравця II, приймуть вигляд

$$a_{11}x_1 + a_{21}(1-x_1), a_{12}x_1 + a_{22}(1-x_1), \dots, a_{1n}x_1 + a_{2n}(1-x_1)$$

або

$$(a_{11} - a_{21})x_1 + a_{21}, (a_{12} - a_{22})x_1 + a_{22}, \dots, (a_{1n} - a_{2n})x_1 + a_{2n},$$

тобто очікувані виграші можна представити у вигляді графіків лінійних функцій, що залежать від змінної x_1 (рис. 10.1, де передбачається, що гравець II має три стратегії).

Лінії, зображені на рис. 10.1, задають залежності середнього виграшу гравця I від значення імовірності x_1 , з якою він вибирає свою першу стратегію, для випадків, коли його супротивник вибирає першу, другу або третю чисту стратегію. Тоді значенням мінімального гарантованого доходу першого гравця відповідає нижня огинаюча всіх трьох прямих. Відповідно до принципу максиміна, оптимальному вибору гравця I відповідатиме найвища точка, що лежить на даній огинаючій, позначена на рисунку як (x_1^*, f^*) . Знаючи її, можна визначити оптимальну змішану стратегію першого гравця $x^* = (x_1^*, 1-x_2^*)$ і ціну гри, що дорівнює f^* .

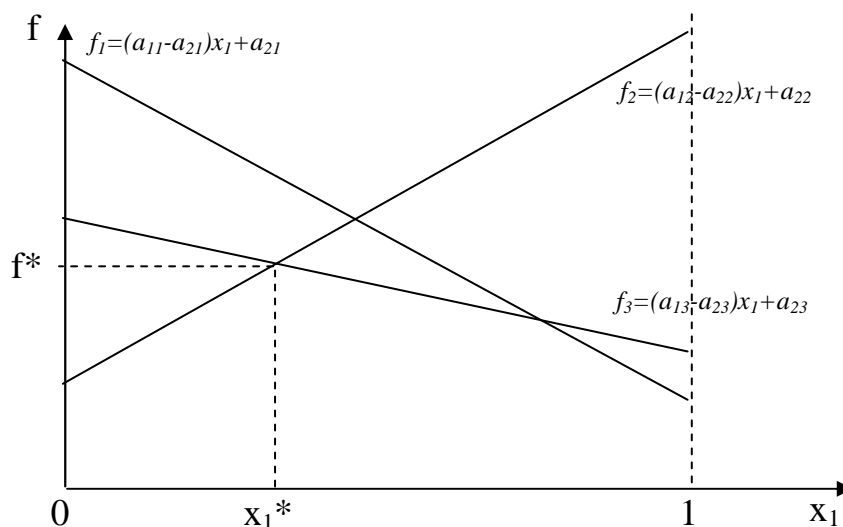


Рис. 10.1 – Графічне вирішення гри

Виходячи з відношення подвійності, яким пов'язані задачі обох гравців, за оптимальною стратегією першого учасника x^* однозначно визначається оптимальна стратегія його супротивника y^* . Оскільки y є результатом розв'язання задачі лінійного програмування, він має всі властивості припустимого базисного плану, тобто у випадку $2 \times n$ гри має не більш за два ненульових компоненти й не менш за $(n-2)$ нульових. Номера ненульових елементів y^* визначають номерами ліній, перетинання яких визначило оптимальну стратегію першого гравця. Дійсно, гравець II знає оптимальну стратегію суперника, і застосування ним стратегій, що відповідають прямим, які проходять вище за точку (x_1^*, f^*) , тільки збільшить його програш. У розглянутому прикладі це лінії f_2 і f_3 , і, отже, у своїй оптимальній стратегії другий гравець повинен з ненульовими імовірностями застосовувати другу і третю чисті стратегії ($y_2 > 0, y_3 > 0$). На основі цього, а також з огляду на умову нормування

$$\sum_{j=1}^n y_j = 1,$$

можна виразити: $y_3 = 1 - y_2$, тоді оптимальне значення y_2^* можна знайти з умови

$$a_{11} \times 0 + a_{21} y_2^* + a_{31} (1 - y_2^*) = a_{12} \times 0 + a_{22} y_2^* + a_{32} (1 - y_2^*)$$

або

$$(a_{21} - a_{31}) y_2^* + a_{31} = (a_{22} - a_{32}) y_2^* + a_{32}.$$

В результаті дістанемо оптимальну стратегію гравця II $y^* = (0, y_2^*, y_3^*)$.

Очевидно, що пошук розв'язання в грі $m \times 2$ здійснюють аналогічно: будують графіки очікуваного програшу гравця II, знаходять їх верхню огинаючу й так далі.

Безумовно, графічний спосіб в силу обмеженості кола задач, до яких його можна застосовувати, має скоріше теоретичне, чим практичне значення. Однак він добре ілюструє змістовну сторону процесу пошуку розв'язку в грі.

Контрольні запитання

11. Коротко сформулюйте предмет теорії ігор як наукової дисципліни.
12. Який зміст вкладають в поняття «гра»?
13. Для опису яких економічних ситуацій можна застосовувати апарат теорії ігор?
14. Яку гру називають антагоністичною?
15. Чим однозначно визначаються матричні ігри?
16. В чому полягають принципи максиміна і мінімакса?
17. За яких умов можна говорити про те, що гра має сідлову точку?
18. Наведіть приклади ігор, які мають сідлову точку й у яких вона відсутня.
19. Які підходи існують до визначення оптимальних стратегій?
20. Що називають «ціною гри»?
21. Дайте визначення поняттю «змішана стратегія».
22. Сформулюйте основну теорему матричних ігор.

СПИСОК ДЖЕРЕЛ

- 1 Вітлінський В. В., Наконечний С. І., Терещенко Т. О. Математичне програмування. - К.: КНЕУ, 2001.
- 2 Кузнецов Ю. Н., Кузубов В. А., Волощенко А. В. Математическое программирование. - М.: Высш. школа, 1980. - 240с.
- 3 Акулич И. Л. Математическое программирование в примерах и задачах. - М.: Высш. школа, 1986. - 244с.
- 4 Таха Х. А. Введение в исследование операций. - М.: Изд. дом «Вильямс», 2005.
- 5 Исследование операций в экономике: Уч. пособие для вузов / Н.Ш. Кремер, Б.А. Путко, И.М. Тришин, М.Н. Фридман. / Под ред. проф. Н.Ш. Кремера. - М.: ЮНИТИ, 2003. - 407 с.
- 6 Акоф Р., Сасиени М. Основы исследования операций. - М.: Мир, 1971.
- 7 Цифровий репозиторій ХНАМГ: <http://eprints.ksame.kharkov.ua>
- 8 <http://www.mat.net.ua>.
- 9 <http://www.matprog.com>.
- 10 <http://www.allmath.ru>.

НАВЧАЛЬНЕ ВИДАННЯ

ОХРИМЕНКО Вячеслав Миколайович,
ВОРОНКОВА Тетяна Борисівна,
ВОРОНКОВ Олексій Олександрович

Конспект лекцій
з курсу

«МАТЕМАТИЧНЕ ПРОГРАМУВАННЯ»

*(для слухачів другої вищої освіти ФПО та ЗН
спеціальностей 7.050107 «Економіка підприємства»,
7.050106 «Облік і аудит»)*

Відповідальний за випуск *А. Є. Ачкасов*

За редакцією авторів

Комп'ютерне верстання *І. В. Волосожарова*

План 2011, поз. 246Л

Підп. до друку 19.10.11
Друк на різнографі.
Зам. №

Формат 60x84 /16
Ум. друк. арк. 7,2
Тираж 50 пр.

Видавець і виготовлювач:
Харківська національна академія міського господарства,
вул. Революції, 12, Харків, 61002
Електронна адреса: rectorat@ksame.kharkov.ua
Свідоцтво суб'єкта видавничої справи:
ДК № 4064 від 12.05.2011 р.